

Fecha de Publicación: 16 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 14 de noviembre de 2013 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1483,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	292,5	154,7	35,0	39,5	35,7	169,0	84,0
15-35	514,5	475,5	288,0	129,0	7,0	205,0	180,5
36-60	91,9	7,1	0,0	2,5	1,2	83,5	5,9
61-90	28,1	10,2	0,0	0,0	0,2	18,1	10,0
91-180	42,3	108,5	60,0	0,0	38,5	32,3	10,0
>180	0,2	48,0	0,0	0,0	48,0	0,2	0,0
Total	969,5	804,0	383,0	171,0	130,6	508,1	290,4

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,9 %	3,4 %	2,9 %	3,0 %
15-35	2,7 %	3,2 %	1,9 %	2,5 %
36-60	2,9 %	3,4 %	3,0 %	3,0 %
61-90	3,2 %	3,9 %	3,1 %	3,1 %
91-180	2,1 %	3,3 %	3,2 %	3,1 %
>180	-	3,4 %	3,0 %	3,4 %
Total	2,7 %	3,3 %	2,5 %	2,8 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre				25 al 29 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	124	3390	2688	38	89	3146	3077	21	94	1846	2364
Intragrupa y off-shore***	0	0	1300	1029	0	0	1373	658	0	0	1079	394
Otros	124	19	509	1482	89	38	535	1320	94	21	568	735
Total	143	143	5199	5199	127	127	5054	5054	115	115	3493	3493

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.