

Fecha de Publicación: 21 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 19 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\$1117,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	195,9	167,6	66,0	50,5	7,6	51,4	94,0
15-35	535,7	376,5	109,0	161,0	23,5	130,7	244,0
36-60	23,1	83,5	0,0	0,0	63,5	3,1	20,0
61-90	16,1	23,0	0,0	0,0	23,0	16,1	0,0
91-180	14,2	33,5	0,0	0,0	23,5	4,2	10,0
>180	0,3	15,7	10,0	0,0	5,7	0,3	0,0
Total	785,4	699,8	185,0	211,5	146,8	205,9	368,0

* 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	-2,1 %	1,9 %	2,7 %	0,7 %
15-35	2,0 %	3,0 %	2,9 %	2,6 %
36-60	3,2 %	3,4 %	2,9 %	3,4 %
61-90	-	3,3 %	2,8 %	3,1 %
91-180	3,2 %	3,3 %	3,0 %	3,2 %
>180	-	3,2 %	2,2 %	3,2 %
Total	1,1 %	2,9 %	2,9 %	2,2 %

*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	18 al 22 de noviembre				25 al 29 de noviembre				2 al 6 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	43	98	3589	3449	23	92	2323	2637	25	59	2530	3241
Intragruppo y off-shore***	0	0	1529	847	0	0	1133	424	0	0	1799	627
Otros	98	43	544	1366	92	23	584	978	59	25	339	800
Total	140	140	5662	5662	116	116	4039	4039	84	84	4668	4668

* 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.