

Fecha de Publicación: 22 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 20 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\$1825,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	506,5	370,0	165,6	294,1	59,3	67,4	145,1
15-35	352,1	622,4	446,5	79,0	10,9	108,1	165,0
36-60	35,1	50,9	0,0	0,0	25,9	10,1	25,0
61-90	17,6	6,9	0,0	0,0	6,9	17,6	0,0
91-180	80,5	76,1	0,0	10,0	36,1	30,5	40,0
>180	17,3	74,7	60,0	0,0	4,9	7,5	9,8
Total	1009,1	1201,0	672,1	383,1	144,1	241,2	384,8

* 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	2,0 %	3,1 %	2,3 %	2,5 %
15-35	2,3 %	3,4 %	3,2 %	3,1 %
36-60	3,2 %	3,2 %	3,0 %	3,2 %
61-90	-	3,5 %	2,9 %	3,1 %
91-180	3,1 %	3,2 %	3,1 %	3,1 %
>180	3,2 %	3,1 %	2,9 %	3,1 %
Total	2,3 %	3,3 %	2,7 %	2,9 %

*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	92	3888	3614	25	92	2393	2727	25	62	2759	3522
Intragrupa y off-shore***	0	0	1636	1122	0	0	1175	441	0	0	1849	633
Otros	92	43	588	1376	92	25	596	997	62	25	387	840
Total	135	135	6112	6112	116	116	4165	4165	87	87	4995	4995

* 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.