

Fecha de Publicación: 23 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 21 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\$1575,2 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	402,1	221,8	94,9	104,6	11,9	182,5	115,0
15-35	382,8	725,9	467,5	30,5	20,4	114,3	238,0
36-60	137,8	18,6	0,0	7,8	2,6	114,0	16,0
61-90	11,1	1,6	0,0	0,0	1,6	11,1	0,0
91-180	14,3	3,6	0,0	0,0	3,6	14,3	0,0
>180	11,6	13,0	0,0	0,6	13,0	11,0	0,0
Total	959,7	984,5	562,4	143,5	53,2	447,2	369,0

* 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	2,6 %	2,6 %	3,0 %	2,8 %
15-35	1,5 %	3,4 %	3,2 %	2,9 %
36-60	3,3 %	3,9 %	3,1 %	3,1 %
61-90	-	3,5 %	3,0 %	3,1 %
91-180	-	4,1 %	3,0 %	3,2 %
>180	-	3,3 %	3,1 %	3,2 %
Total	1,9 %	3,3 %	3,0 %	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**	40	89	3926	3655	23	93	2534	2796	25	64	3067	3682
Intragrupa y off-shore***	0	0	1636	1132	0	0	1219	522	0	0	1900	647
Otros	89	40	609	1384	93	23	601	1036	64	25	391	1028
Total	130	130	6171	6171	116	116	4354	4354	89	89	5357	5357

* 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.