

Fecha de Publicación: 26 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 22 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\$1203,3 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	326,4	160,2	58,8	173,5	61,5	112,9	40,0
15-35	221,2	456,2	320,5	68,0	8,2	25,7	127,5
36-60	19,2	10,6	0,0	0,0	0,6	9,2	10,0
61-90	97,2	41,6	0,0	0,0	1,6	57,2	40,0
91-180	28,5	52,8	0,0	0,0	52,8	28,5	0,0
>180	6,5	5,5	0,0	0,0	0,5	1,5	5,0
Total	698,9	726,9	379,3	241,5	125,1	234,9	222,5

* 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	1,5 %	3,5 %	2,3 %	2,5 %
15-35	2,6 %	3,3 %	3,0 %	3,1 %
36-60	3,2 %	3,7 %	3,0 %	3,1 %
61-90	0,0 %	4,0 %	3,0 %	1,8 %
91-180	-	3,3 %	3,0 %	3,2 %
>180	3,2 %	3,3 %	2,6 %	3,1 %
Total	2,0 %	3,4 %	2,6 %	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	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**	39	90	3926	3651	24	95	2743	2871	26	64	3180	3765
Intragrupa y off-shore***	0	0	1636	1132	0	0	1258	673	0	0	1920	670
Otros	90	39	605	1384	95	24	607	1065	64	26	443	1109
Total	130	130	6166	6166	120	120	4608	4608	90	90	5543	5543

* 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.