

Fecha de Publicación: 7 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 05 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\$1926,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,2%.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	575,4	542,8	308,3	146,5	17,0	211,4	217,5
15-35	307,0	538,6	341,8	56,2	11,9	65,9	185,0
36-60	93,3	178,6	0,8	0,0	97,9	13,3	80,0
61-90	45,9	19,9	0,0	0,0	19,9	45,9	0,0
91-180	61,6	16,1	0,0	0,0	16,1	61,6	0,0
>180	25,1	4,9	0,0	0,6	4,9	24,5	0,0
Total	1108,4	1300,9	650,8	203,3	167,6	422,6	482,5

* 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	2,5 %	1,8 %	2,4 %	2,2 %
15-35	-0,4 %	3,0 %	2,6 %	1,8 %
36-60	1,6 %	3,3 %	2,9 %	2,6 %
61-90	-	3,3 %	3,1 %	3,1 %
91-180	-	3,6 %	3,0 %	3,1 %
>180	-	3,5 %	2,9 %	3,0 %
Total	1,2 %	2,6 %	2,6 %	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	4 al 8 de noviembre								11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	76	4192	3732	18	116	2314	2159	30	82	2047	2332				
Intragrupa y off-shore***	0	1	1796	965	0	0	1021	795	0	0	1023	499				
Otros	76	15	542	1833	116	18	457	838	82	30	422	662				
Total	92	92	6530	6530	133	133	3793	3793	112	112	3492	3492				

* 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.