

Fecha de Publicación: 8 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 06 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\$2526,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	988,8	488,1	240,5	497,2	54,2	298,1	193,5
15-35	435,1	646,4	531,9	160,3	6,7	167,1	107,8
36-60	104,9	66,7	0,0	40,0	36,7	34,9	30,0
61-90	11,4	22,7	4,5	0,0	18,2	11,4	0,0
91-180	46,3	10,4	0,0	0,0	10,4	46,3	0,0
>180	36,3	10,5	0,0	0,0	0,5	26,3	10,0
Total	1622,9	1244,8	776,9	697,5	126,7	584,2	341,3

* 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 %	2,9 %	2,7 %	2,7 %
15-35	0,4 %	2,9 %	3,1 %	2,6 %
36-60	0,0 %	3,2 %	3,1 %	2,5 %
61-90	-	3,3 %	3,0 %	3,2 %
91-180	-	3,5 %	3,1 %	3,1 %
>180	0,0 %	3,6 %	3,0 %	2,2 %
Total	1,6 %	2,9 %	2,8 %	2,7 %

*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

Sector	4 al 8 de noviembre						11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V		
Sector Financiero**	16	77	4784	3991	18	115	2677	2276	35	82	2184	2510		
Intragrupa y off-shore***	0	1	1913	1410	0	0	1087	828	0	0	1129	589		
Otros	77	15	546	1842	115	18	463	1122	82	35	473	689		
Total	93	93	7242	7242	133	133	4227	4227	117	117	3787	3787		

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.