

Fecha de Publicación: 12 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 07 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\$1595,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	598,2	275,3	152,5	35,5	15,8	455,7	107,0
15-35	221,8	497,6	432,8	74,0	42,9	125,8	22,0
36-60	6,8	1,4	0,0	0,0	1,4	6,8	0,0
61-90	37,2	22,0	0,0	0,1	22,0	37,1	0,0
91-180	7,2	13,1	0,0	0,1	13,1	7,1	0,0
>180	14,3	40,1	30,0	0,4	0,1	3,9	10,0
Total	885,5	849,4	615,3	110,1	95,1	636,3	139,0

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

*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**	17	78	4833	4139	18	117	2942	2348	35	82	2513	2591
Intragrupa y off-shore***	0	1	2013	1410	0	0	1109	844	0	0	1160	609
Otros	78	16	574	1872	117	18	476	1335	82	35	474	948
Total	95	95	7420	7420	136	136	4527	4527	117	117	4147	4147

* 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.