

Fecha de Publicación: 13 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 08 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\$1121,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	379,2	402,7	118,0	101,0	64,5	58,0	220,3
15-35	212,7	345,3	237,5	64,9	4,8	44,8	103,0
36-60	27,7	23,1	0,0	0,0	2,4	7,0	20,7
61-90	4,5	12,2	0,0	0,0	12,2	4,5	0,0
91-180	12,2	3,2	0,0	0,0	3,2	12,2	0,0
>180	18,4	28,6	20,0	0,0	4,1	14,0	4,5
Total	654,8	815,1	375,5	165,9	91,2	140,5	348,4

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

*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	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	78	4833	4146	19	121	3174	2565	35	84	2680	2786
Intragrupa y off-shore***	0	1	2013	1410	0	0	1201	933	0	0	1186	621
Otros	78	15	582	1872	121	19	496	1373	84	35	528	988
Total	95	95	7428	7428	139	139	4871	4871	119	119	4394	4394

* 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.