

Fecha de Publicación: 15 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 13 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\$1409,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	237,9	147,0	103,5	62,7	13,5	145,2	30,0
15-35	388,0	511,5	298,9	78,0	28,2	125,7	184,3
36-60	26,5	1,3	0,0	0,0	1,3	26,5	0,0
61-90	95,5	36,2	0,0	20,0	16,2	55,5	20,0
91-180	84,6	39,3	0,0	35,0	29,3	39,6	10,0
>180	56,0	75,2	0,0	0,0	30,2	11,0	45,0
Total	888,5	810,4	402,4	195,7	118,7	403,5	289,3

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

*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	11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre				25 al 29 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	123	3387	2674	37	86	2919	3017	20	94	1776	2269
Intragrupa y off-shore***	0	0	1291	1029	0	0	1351	622	0	0	1075	390
Otros	123	20	504	1479	86	37	534	1165	94	20	534	727
Total	142	142	5183	5183	123	123	4805	4805	114	114	3386	3386

* 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.