

Fecha de Publicación: 20 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 18 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\$759,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	264,1	148,4	32,5	18,5	3,9	133,6	112,0
15-35	235,1	135,3	36,6	110,8	15,8	41,3	83,0
36-60	16,3	44,9	0,0	0,0	34,9	6,3	10,0
61-90	19,9	5,7	0,0	0,0	5,7	19,9	0,0
91-180	26,1	16,3	0,0	0,0	6,3	16,1	10,0
>180	60,0	42,7	0,0	0,0	2,7	20,0	40,0
Total	621,4	393,4	69,1	129,3	69,4	237,1	255,0

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

*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	18 al 22 de noviembre				25 al 29 de noviembre				2 al 6 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	43	98	3526	3369	23	92	2203	2562	25	59	2318	3120
Intragrupa y off-shore***	0	0	1488	829	0	0	1108	394	0	0	1734	490
Otros	98	43	545	1361	92	23	577	933	59	25	338	782
Total	141	141	5559	5559	115	115	3888	3888	84	84	4391	4391

* 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.