

Fecha de Publicación: 27 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 25 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\$1451,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	397,3	229,3	17,0	69,0	2,3	118,3	210,0
15-35	386,9	571,3	296,5	92,3	43,8	63,6	231,0
36-60	124,7	150,4	0,0	0,0	70,4	44,7	80,0
61-90	9,7	2,1	0,0	0,0	2,1	9,7	0,0
91-180	60,8	37,0	25,0	45,0	12,0	15,8	0,0
>180	2,7	0,6	0,0	0,0	0,6	2,7	0,0
Total	982,0	990,7	338,5	206,3	131,2	254,8	521,0

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

*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	25 al 29 de noviembre				2 al 6 de diciembre				9 al 13 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	97	2878	2926	27	64	3435	3921	6	73	2245	2630
Intragrupa y off-shore***	0	0	1258	732	0	0	1927	680	0	0	1268	633
Otros	97	25	607	1086	64	27	443	1205	73	6	527	776
Total	121	121	4744	4744	90	90	5805	5805	79	79	4040	4040

* 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.