

Fecha de Publicación: 29 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 27 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\$1660,2 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	436,7	268,6	76,0	134,0	4,6	114,7	188,0
15-35	356,2	526,2	370,7	178,1	36,1	58,6	119,5
36-60	86,6	21,2	10,6	0,3	10,6	86,3	0,0
61-90	26,9	62,2	60,0	10,8	2,2	16,1	0,0
91-180	81,9	61,3	30,0	40,6	6,3	16,3	25,0
>180	2,7	62,3	45,0	0,0	17,3	2,7	0,0
Total	990,9	1001,8	592,3	363,8	77,1	294,7	332,5

* 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	2,4 %	3,3 %	2,3 %	2,5 %
15-35	2,3 %	3,0 %	3,4 %	3,0 %
36-60	-	3,4 %	3,2 %	3,2 %
61-90	-	3,2 %	3,1 %	3,2 %
91-180	3,2 %	3,4 %	3,1 %	3,3 %
>180	-	3,6 %	3,1 %	3,6 %
Total	2,4 %	3,1 %	2,8 %	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**	24	91	3119	3197	29	65	3832	4194	7	74	2566	2923
Intragrupa y off-shore***	0	0	1338	802	0	0	2135	852	0	0	1317	719
Otros	91	24	644	1102	65	29	444	1366	74	7	620	861
Total	116	116	5100	5100	94	94	6412	6412	81	81	4503	4503

* 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.