

Fecha de Publicación: 02 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 28 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\$278,8 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	77,3	75,8	0,0	1,3	22,8	23,1	53,0
15-35	142,5	136,1	0,0	9,0	6,1	3,5	130,0
36-60	3,6	1,8	0,0	0,0	1,8	3,6	0,0
61-90	0,0	5,1	0,0	0,0	5,1	0,0	0,0
91-180	13,0	6,2	0,0	0,0	6,2	13,0	0,0
>180	0,0	0,2	0,0	0,0	0,2	0,0	0,0
Total	236,5	225,3	0,0	10,3	42,3	43,2	183,0

* 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	3,5 %	3,2 %	3,1 %	3,3 %
15-35	3,3 %	3,7 %	2,8 %	3,3 %
36-60	-	1,7 %	3,2 %	2,7 %
61-90	-	3,6 %	3,3 %	3,6 %
91-180	-	3,5 %	3,1 %	3,3 %
>180	-	3,9 %	-	3,9 %
Total	3,4 %	3,3 %	3,1 %	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	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**	27	93	3114	3220	30	66	3836	4195	7	74	2639	2973
Intragrupa y off-shore***	0	0	1338	802	0	1	2135	852	0	0	1317	719
Otros	93	27	666	1097	66	29	443	1366	74	7	621	884
Total	121	121	5118	5118	96	96	6414	6414	81	81	4577	4577

* 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.