

Fecha de Publicación: 3 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 29 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\$691,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	352,8	247,1	6,0	65,0	2,1	48,8	239,0
15-35	59,3	179,9	64,6	5,0	95,3	34,3	20,0
36-60	44,4	23,4	0,0	0,0	3,4	24,4	20,0
61-90	8,1	25,1	0,0	0,0	25,1	8,1	0,0
91-180	5,0	8,3	0,0	0,0	8,3	5,0	0,0
>180	11,6	13,9	5,0	0,0	0,9	3,6	8,0
Total	481,1	497,7	75,6	70,0	135,1	124,1	287,0

* 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	3,1 %	3,7 %	2,9 %	3,1 %
15-35	3,6 %	4,0 %	1,4 %	3,6 %
36-60	3,7 %	3,7 %	3,2 %	3,5 %
61-90	-	3,6 %	3,2 %	3,5 %
91-180	-	3,5 %	3,2 %	3,4 %
>180	0,0 %	3,3 %	3,1 %	1,8 %
Total	3,1 %	3,9 %	2,7 %	3,2 %

*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	99	3114	3202	56	68	3999	4311	9	75	2798	3105
Intragrupa y off-shore***	0	0	1338	802	0	26	2135	887	0	0	1323	724
Otros	99	27	648	1097	68	29	445	1380	75	9	622	913
Total	126	126	5100	5100	124	124	6578	6578	84	84	4743	4743

* 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.