

Fecha de Publicación: 12 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 10 de diciembre 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\$2340,9 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	781,8	281,5	134,8	551,0	3,7	87,8	143,0
15-35	338,1	838,6	662,8	196,5	69,8	35,6	106,0
36-60	43,3	64,5	50,0	0,0	14,5	43,3	0,0
61-90	44,9	40,7	4,3	0,0	11,4	19,9	25,0
91-180	24,0	79,5	75,0	0,0	4,5	24,0	0,0
>180	45,3	67,9	30,0	10,0	2,9	0,3	35,0
Total	1277,4	1372,5	956,8	757,5	106,7	210,9	309,0

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

Sector	9 al 13 de diciembre				16 al 20 de diciembre				23 al 27 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	90	4089	3785	29	138	3667	3958	5	103	1549	2521
Intragrupa y off-shore***	0	0	1675	1451	0	0	1639	758	0	0	1619	675
Otros	90	24	674	1201	138	29	563	1152	103	5	299	271
Total	114	114	6438	6438	167	167	5869	5869	108	108	3467	3467

* 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.