

Fecha de Publicación: 13 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 11 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\$2501,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	458,5	254,3	189,5	349,8	9,8	53,7	55,0
15-35	502,5	877,0	710,4	299,6	24,6	61,0	142,0
36-60	111,1	50,4	5,0	0,0	25,4	91,1	20,0
61-90	89,3	90,2	50,0	17,0	35,2	67,3	5,0
91-180	28,5	77,1	50,0	0,0	27,1	28,5	0,0
>180	77,2	156,9	100,0	27,0	6,9	0,2	50,0
Total	1267,1	1505,9	1104,9	693,4	129,0	301,8	272,0

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

*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	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**	25	88	4224	3919	48	138	3926	4064	6	101	1600	2546
Intragrupa y off-shore***	0	0	1792	1548	0	0	1700	966	0	0	1635	720
Otros	88	25	681	1230	138	48	562	1158	101	6	302	271
Total	113	113	6696	6696	185	185	6188	6188	107	107	3537	3537

* 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.