

Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 12 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\$1535,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	440,2	203,7	48,0	201,5	50,7	133,7	105,0
15-35	353,7	385,5	269,0	210,0	6,9	34,1	109,6
36-60	100,0	106,1	72,5	0,0	13,7	80,0	20,0
61-90	91,0	38,1	10,0	65,0	3,1	1,0	25,0
91-180	1,6	38,9	34,0	0,0	4,9	1,6	0,0
>180	26,5	35,1	0,0	0,0	10,1	1,5	25,0
Total	1013,0	807,5	433,5	476,5	89,4	251,9	284,6

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

*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		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	89	4261	3950	48	140	4242	4221	6	101	1686	2600				
Intragrupa y off-shore***	0	0	1792	1564	0	0	1748	1081	0	0	1669	791				
Otros	89	25	692	1231	140	48	601	1289	101	6	307	272				
Total	114	114	6745	6745	188	188	6591	6591	107	107	3663	3663				

* 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.