

Fecha de Publicación: 17 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 13 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\$1691,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	519,1	225,0	63,0	309,5	13,0	60,6	149,0
15-35	436,2	372,7	321,0	311,0	6,7	80,2	45,0
36-60	48,1	140,2	136,6	0,0	3,6	48,1	0,0
61-90	5,6	52,1	20,0	0,0	27,1	0,6	5,0
91-180	3,2	35,1	25,0	0,0	10,1	3,2	0,0
>180	9,1	49,2	44,0	0,0	0,2	4,1	5,0
Total	1021,3	874,3	609,6	620,5	60,7	196,8	204,0

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

*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	4261	3951	48	140	4639	4413	6	101	1808	2635
Intragrupa y off-shore***	0	0	1792	1564	0	0	1781	1273	0	0	1699	908
Otros	87	25	693	1231	140	48	616	1349	101	6	307	272
Total	113	113	6746	6746	189	189	7035	7035	107	107	3815	3815

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.