

Fecha de Publicación: 18 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 16 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\$1636,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	298,9	211,7	116,0	160,9	27,7	70,0	68,0
15-35	628,5	332,5	211,0	187,0	2,5	322,5	119,0
36-60	185,1	61,7	0,0	0,0	16,7	140,1	45,0
61-90	8,5	4,4	0,0	0,0	4,4	8,5	0,0
91-180	1,8	125,1	115,0	0,0	10,1	1,8	0,0
>180	8,9	6,4	0,0	0,0	1,4	3,9	5,0
Total	1131,7	741,6	442,0	347,9	62,6	546,8	237,0

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

*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	16 al 20 de diciembre				23 al 27 de diciembre				30 de dic. al 3 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	48	143	4827	4605	6	102	1913	2645	5	29	1185	1862
Intragrupa y off-shore***	0	0	1897	1354	0	0	1699	988	0	0	1271	569
Otros	143	48	652	1416	102	6	294	273	29	5	173	198
Total	191	191	7376	7376	108	108	3906	3906	34	34	2629	2629

* 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.