

Fecha de Publicación: 19 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 17 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\$1592,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,9%.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	169,0	137,6	44,0	42,0	14,1	47,5	79,5
15-35	724,5	508,2	309,5	388,0	17,7	155,5	181,0
36-60	40,8	35,6	0,0	0,0	30,6	35,8	5,0
61-90	40,6	72,4	35,0	0,5	7,4	10,0	30,0
91-180	23,3	102,6	100,0	0,0	2,6	23,3	0,0
>180	18,2	20,1	0,0	0,0	15,1	13,2	5,0
Total	1016,3	876,4	488,5	430,5	87,4	285,2	300,5

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

*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	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**	47	142	4908	4690	8	106	2000	2704	5	29	1393	1900
Intragrupa y off-shore***	0	0	1961	1364	0	0	1699	1020	0	0	1271	733
Otros	142	47	643	1458	106	8	303	279	29	5	170	201
Total	189	189	7512	7512	113	113	4002	4002	34	34	2834	2834

* 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.