

Fecha de Publicación: 20 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 18 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\$1407,5 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	201,7	82,6	64,0	173,0	1,6	11,7	17,0
15-35	432,4	461,4	335,5	110,3	12,9	209,1	113,0
36-60	132,2	95,9	0,0	0,0	35,9	72,2	60,0
61-90	27,3	25,5	0,0	0,0	15,5	17,3	10,0
91-180	63,3	16,4	10,0	0,0	6,4	63,3	0,0
>180	62,3	21,4	0,0	0,0	6,4	47,3	15,0
Total	919,4	703,1	409,5	283,3	78,6	421,1	215,0

* 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	3,3 %	2,9 %	2,5 %	2,7 %
15-35	2,0 %	3,0 %	2,8 %	2,8 %
36-60	0,0 %	3,1 %	2,7 %	1,8 %
61-90	2,8 %	3,1 %	2,6 %	2,8 %
91-180	-	3,9 %	2,7 %	2,9 %
>180	3,1 %	3,4 %	2,7 %	2,8 %
Total	1,7 %	3,0 %	2,7 %	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	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**	46	137	5098	4754	8	106	2011	2741	6	29	1429	1954
Intragrupa y off-shore***	0	0	1981	1532	0	0	1754	1025	0	0	1298	743
Otros	137	46	670	1462	105	8	285	285	29	6	171	202
Total	183	183	7749	7749	113	113	4050	4050	36	36	2899	2899

* 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.