

Fecha de Publicación: 24 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 20 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\$986,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.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	170,5	67,5	7,0	109,0	23,5	24,5	37,0
15-35	188,2	414,1	282,5	69,8	61,6	48,4	70,0
36-60	2,6	22,0	2,8	0,0	19,1	2,6	0,0
61-90	23,1	54,8	0,0	0,0	34,8	3,1	20,0
91-180	21,6	32,3	0,0	0,0	32,3	21,6	0,0
>180	70,5	56,3	5,0	60,0	41,3	0,5	10,0
Total	476,4	647,0	297,3	238,8	212,7	100,6	137,0

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

*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

Sector	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**	44	126	5153	4811	18	105	2245	2768	7	29	1499	2016
Intragrupa y off-shore***	0	0	1981	1545	0	0	1761	1215	0	0	1308	774
Otros	126	44	692	1469	105	18	286	309	29	7	187	203
Total	170	170	7826	7826	124	124	4292	4292	36	36	2994	2994

* 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.