

Fecha de Publicación: 25 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 23 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\$1099,6 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	81,8	106,2	84,0	55,0	7,2	11,8	15,0
15-35	221,2	333,4	242,9	167,0	45,5	9,2	45,0
36-60	112,0	113,5	100,0	16,5	13,5	95,5	0,0
61-90	98,8	33,4	10,0	55,0	13,4	33,8	10,0
91-180	27,5	39,2	0,0	0,0	39,2	27,5	0,0
>180	0,0	2,7	0,0	0,0	2,7	0,0	0,0
Total	541,2	628,4	436,9	293,5	121,5	177,7	70,0

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

Sectores	23 al 27 de diciembre				30 de dic. al 3 de enero				6 al 10 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	106	2295	2800	7	35	1527	2083	49	55	2643	3483
Intragrupa y off-shore***	0	0	1795	1265	0	0	1358	779	0	0	2136	979
Otros	106	21	284	309	35	7	188	212	55	49	495	812
Total	127	127	4374	4374	42	42	3074	3074	104	104	5274	5274

* 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.