

Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 24 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\$481,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.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	57,7	68,5	52,0	45,5	4,5	0,2	12,0
15-35	152,0	179,2	90,0	52,0	5,3	16,0	84,0
36-60	0,0	5,9	0,0	0,0	5,9	0,0	0,0
61-90	35,8	58,3	20,0	0,0	3,3	0,8	35,0
91-180	0,0	36,7	20,0	0,0	16,7	0,0	0,0
>180	14,5	9,1	0,0	3,0	4,1	6,5	5,0
Total	260,0	357,8	182,0	100,5	39,8	23,5	136,0

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

*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	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**	20	107	2349	2809	7	36	1532	2140	49	55	2671	3497		
Intragrupa y off-shore***	0	0	1795	1310	0	0	1410	779	0	0	2136	979		
Otros	106	20	286	311	36	7	188	212	55	49	497	828		
Total	127	127	4431	4431	43	43	3131	3131	104	104	5304	5304		

* 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.