

Fecha de Publicación: 3 de enero de 2014

Fecha de Información: 30 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\$1344,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	394,2	146,8	15,0	256,0	5,8	12,2	126,0
15-35	209,5	452,6	331,0	129,8	76,6	34,7	45,0
36-60	20,0	65,9	30,0	3,0	30,9	12,0	5,0
61-90	121,8	26,4	0,0	40,0	26,4	81,8	0,0
91-180	34,0	33,1	0,0	0,0	8,1	9,0	25,0
>180	40,6	40,9	0,0	0,0	0,9	0,6	40,0
Total	820,0	765,6	376,0	428,8	148,6	150,2	241,0

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

*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	30 de dic. al 3 de enero				6 al 10 de enero				13 al 17 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	35	1928	2358	51	56	3123	3688	19	141	2911	2865
Intragrupo y off-shore***	0	0	1545	1096	0	0	2204	1284	0	0	1667	909
Otros	35	8	200	219	56	51	512	866	141	19	418	1222
Total	43	43	3673	3673	106	106	5839	5839	160	160	4996	4996

* 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.