

Fecha de Publicación: 4 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 02 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\$1330,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	495,0	250,8	62,1	208,1	38,7	136,9	150,0
15-35	134,1	385,7	314,0	48,3	6,2	20,4	65,5
36-60	126,9	91,7	0,0	7,4	81,7	109,5	10,0
61-90	10,2	0,7	0,0	0,0	0,7	10,2	0,0
91-180	30,4	36,3	0,0	0,2	6,3	0,2	30,0
>180	11,7	14,4	5,0	1,0	6,9	8,3	2,5
Total	808,4	779,6	381,1	264,9	140,5	285,4	258,0

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

* 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	2 al 6 de diciembre				9 al 13 de diciembre				16 al 20 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	57	70	4301	4447	13	78	2947	3208	14	120	2946	3526
Intragrupa y off-shore***	0	26	2144	1058	0	0	1376	761	0	0	1429	486
Otros	70	30	442	1382	78	13	656	1010	120	14	550	913
Total	127	127	6887	6887	90	90	4979	4979	134	134	4925	4925

* 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.