

Fecha de Publicación: 6 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 04 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\$1944,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	543,4	319,2	192,1	379,1	11,6	48,8	115,5
15-35	249,1	654,7	486,7	76,9	13,0	17,2	155,0
36-60	144,6	56,4	0,0	0,0	56,4	144,6	0,0
61-90	63,5	59,4	15,0	0,0	4,4	23,5	40,0
91-180	70,1	3,7	0,0	25,0	3,7	45,1	0,0
>180	49,2	74,9	35,9	0,0	6,0	16,2	33,0
Total	1120,0	1168,3	729,7	481,0	95,1	295,5	343,5

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

*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**	24	70	4787	4639	14	77	3140	3461	16	127	3116	3638
Intragrupa y off-shore***	0	1	2242	1434	0	0	1540	808	0	0	1508	565
Otros	70	23	446	1401	77	14	671	1082	127	16	549	970
Total	94	94	7474	7474	91	91	5351	5351	143	143	5173	5173

* 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.