

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

| Sector | 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.