

Fecha de Publicación: 07 de enero de 2014

Fecha de Información: 02 de enero de 2014 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\$898,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,5%.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	113,0	145,1	125,0	66,0	1,1	28,0	19,0
15-35	116,1	541,2	465,8	29,3	12,5	23,8	63,0
36-60	11,3	12,5	0,0	0,0	12,5	11,3	0,0
61-90	6,8	28,3	8,0	0,0	15,3	1,8	5,0
91-180	0,0	10,1	0,0	0,0	10,1	0,0	0,0
>180	0,0	1,5	0,0	0,0	1,5	0,0	0,0
Total	247,2	738,8	598,8	95,3	53,0	64,9	87,0

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

*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

Sectores	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	1974	2363	50	60	3144	3795	20	142	2956	2895
Intragrupa y off-shore***	0	0	1550	1142	0	0	2309	1284	0	0	1683	929
Otros	35	8	201	219	60	50	510	883	142	20	417	1232
Total	43	43	3724	3724	110	110	5962	5962	161	161	5056	5056

* 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.