

Fecha de Publicación: 8 de enero de 2014

Fecha de Información: 03 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\$820,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.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	304,1	301,2	165,1	111,0	0,1	57,1	136,0
15-35	178,9	185,2	87,0	88,1	12,2	4,8	86,0
36-60	0,0	4,7	0,0	0,0	4,7	0,0	0,0
61-90	5,0	6,5	0,0	0,0	1,5	0,0	5,0
91-180	0,0	2,0	0,0	0,0	2,0	0,0	0,0
>180	12,6	59,5	21,9	0,0	25,0	0,0	12,6
Total	500,6	559,2	274,0	199,1	45,6	62,0	239,6

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

*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	36	1974	2363	56	60	3382	4019	39	138	2997	2975
Intragrupa y off-shore***	0	0	1550	1142	0	0	2406	1394	0	1	1751	929
Otros	36	8	201	219	60	56	511	885	138	38	419	1263
Total	43	43	3724	3724	116	116	6298	6298	177	177	5167	5167

* 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.