

Fecha de Publicación: 9 de enero de 2014

Fecha de Información: 07 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\$826,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	161,5	98,9	39,5	106,7	18,4	13,8	41,0
15-35	180,2	288,4	165,3	40,2	88,1	105,0	35,0
36-60	10,6	19,7	0,0	0,0	9,7	0,6	10,0
61-90	58,9	16,7	5,0	20,0	6,7	33,9	5,0
91-180	0,8	21,2	0,0	0,0	21,2	0,8	0,0
>180	13,5	56,7	0,8	0,0	45,9	3,5	10,0
Total	425,4	501,5	210,6	166,9	190,0	157,5	101,0

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

*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

Sector	6 al 10 de enero						13 al 17 de enero				20 al 24 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V		
Sector Financiero**	54	65	3441	4058	40	138	3092	3021	5	169	1885	2233		
Intragrupa y off-shore***	0	0	2409	1410	0	1	1784	1019	0	0	1064	226		
Otros	65	54	506	888	138	39	432	1268	169	5	445	936		
Total	119	119	6356	6356	179	179	5308	5308	173	173	3395	3395		

* 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.