

Fecha de Publicación: 13 de enero de 2014

Fecha de Información: 09 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\$1293,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	268,0	261,7	100,8	107,6	8,9	8,4	152,0
15-35	426,7	504,9	295,0	114,5	71,9	174,2	138,0
36-60	11,1	27,4	20,6	0,0	5,5	9,7	1,4
61-90	24,4	6,5	0,0	0,0	1,5	19,4	5,0
91-180	6,2	42,8	30,0	0,0	7,8	1,2	5,0
>180	13,1	12,4	0,0	0,0	2,4	3,1	10,0
Total	749,5	855,7	446,3	222,1	98,0	216,0	311,4

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

*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	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	67	3684	4143	53	140	3304	3284	9	168	1960	2357
Intragrupa y off-shore***	0	0	2437	1595	0	1	1903	1086	0	0	1108	267
Otros	67	54	513	896	140	52	447	1284	168	9	496	940
Total	121	121	6634	6634	192	192	5654	5654	178	178	3564	3564

* 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.