

Fecha de Publicación: 14 de enero de 2014

Fecha de Información: 10 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\$1289,9 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	162,3	73,6	33,5	130,2	15,1	7,1	25,0
15-35	511,0	480,4	251,5	258,3	118,3	142,2	110,6
36-60	0,4	3,4	0,0	0,0	3,4	0,4	0,0
61-90	10,0	35,5	14,0	0,0	11,5	0,0	10,0
91-180	10,2	14,8	0,0	0,0	14,8	10,2	0,0
>180	30,1	103,7	0,0	30,0	103,7	0,1	0,0
Total	724,1	711,4	299,0	418,5	266,8	160,0	145,6

* 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	5,6 %	1,9 %	0,8 %	1,6 %
15-35	3,1 %	3,2 %	2,8 %	3,0 %
36-60	-	3,6 %	3,4 %	3,6 %
61-90	3,2 %	3,4 %	-	3,3 %
91-180	-	2,7 %	3,1 %	2,8 %
>180	-	3,6 %	3,4 %	3,5 %
Total	3,5 %	3,2 %	2,4 %	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	67	3684	4143	53	144	3425	3350	9	168	2001	2367
Intragrupa y off-shore***	0	0	2437	1595	0	1	1936	1175	0	0	1108	308
Otros	67	54	513	896	144	52	455	1291	168	9	505	940
Total	120	120	6633	6633	197	197	5816	5816	178	178	3614	3614

* 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.