

Fecha de Publicación: 15 de enero de 2014

Fecha de Información: 13 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\$1213,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	153,8	114,2	82,5	110,5	3,7	15,3	28,0
15-35	354,1	400,0	319,0	192,0	63,0	144,1	18,0
36-60	136,2	96,6	2,0	0,0	40,6	82,2	54,0
61-90	10,6	7,6	4,5	0,0	3,1	10,6	0,0
91-180	11,2	3,7	0,0	0,0	3,7	11,2	0,0
>180	12,6	13,2	0,0	10,0	13,2	2,6	0,0
Total	678,6	635,3	408,0	312,5	127,3	266,1	100,0

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

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	13 al 17 de enero				20 al 24 de enero				27 al 31 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	57	146	3544	3417	9	169	2017	2407	9	63	1886	2246
Intragrupoy off-shore***	0	1	1983	1276	0	0	1144	318	0	0	1209	426
Otros	146	56	457	1291	169	9	505	941	63	9	450	873
Total	202	202	5984	5984	178	178	3666	3666	72	72	3545	3545

* 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.