

Fecha de Publicación: 17 de enero de 2014

Fecha de Información: 15 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\$1636,2 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	508,3	252,0	109,5	187,0	2,5	181,3	140,0
15-35	281,5	667,1	489,0	82,6	59,1	79,9	119,0
36-60	33,4	65,8	0,0	0,0	55,8	23,4	10,0
61-90	18,5	39,3	0,0	0,0	34,3	13,5	5,0
91-180	11,4	4,7	0,0	0,0	4,7	11,4	0,0
>180	25,8	22,7	0,0	0,0	2,7	5,8	20,0
Total	878,8	1051,5	598,5	269,6	159,0	315,2	294,0

* 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	2,1 %	3,6 %	3,1 %	2,9 %
15-35	2,9 %	3,2 %	3,0 %	3,1 %
36-60	3,2 %	3,3 %	2,9 %	3,2 %
61-90	3,2 %	3,3 %	3,0 %	3,2 %
91-180	-	3,3 %	3,1 %	3,2 %
>180	3,3 %	1,6 %	2,4 %	3,0 %
Total	2,6 %	3,2 %	3,1 %	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**	56	147	3926	3568	16	169	2345	2611	10	62	1998	2350
Intragruppo y off-shore***	0	1	2057	1530	0	0	1250	340	0	0	1214	431
Otros	147	55	458	1343	169	16	505	1149	62	10	454	885
Total	202	202	6441	6441	184	184	4100	4100	72	72	3666	3666

* 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.