

Fecha de Publicación: 20 de enero de 2014

Fecha de Información: 16 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\$1766,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	293,6	149,3	82,3	47,1	2,1	181,4	65,0
15-35	483,0	825,0	537,3	84,0	3,7	115,0	284,0
36-60	107,6	33,8	31,0	1,7	2,8	105,9	0,0
61-90	20,2	45,1	38,0	0,0	7,1	20,2	0,0
91-180	51,3	8,4	0,0	0,0	8,4	51,3	0,0
>180	76,7	27,0	0,0	1,1	22,0	70,5	5,0
Total	1032,2	1088,6	688,5	134,0	46,1	544,2	354,0

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

* 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	147	3976	3595	17	169	2491	2728	10	62	2094	2355
Intragruppo y off-shore***	0	1	2081	1577	0	0	1306	340	0	0	1217	431
Otros	147	56	461	1346	169	17	502	1230	62	10	456	981
Total	204	204	6518	6518	185	185	4298	4298	72	72	3767	3767

* 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.