

Fecha de Publicación: 21 de enero de 2014

Fecha de Información: 17 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\$1295,7 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	227,4	170,0	38,8	80,0	24,3	40,4	107,0
15-35	276,5	601,4	432,9	11,2	32,6	129,3	136,0
36-60	62,8	36,5	0,0	3,2	6,5	29,5	30,0
61-90	13,8	23,7	0,0	0,2	18,7	8,6	5,0
91-180	47,4	6,3	0,0	0,0	6,3	47,4	0,0
>180	83,4	24,5	0,0	10,0	24,5	73,4	0,0
Total	711,3	862,4	471,6	104,7	112,8	328,7	278,0

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

*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	145	3976	3595	18	142	2679	2885	10	62	2133	2395
Intragrupoy off-shore***	0	1	2081	1577	0	0	1338	411	0	0	1223	440
Otros	145	56	461	1346	142	18	541	1263	62	10	468	989
Total	202	202	6518	6518	160	160	4558	4558	72	72	3823	3823

* 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.