

Fecha de Publicación: 23 de enero de 2014

Fecha de Información: 21 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\$2158,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	429,5	81,6	57,6	121,0	8,1	292,5	16,0
15-35	492,3	756,3	445,8	123,3	146,4	205,0	164,0
36-60	165,2	165,1	60,0	6,6	91,6	145,0	13,5
61-90	4,4	11,1	5,0	0,2	6,1	4,2	0,0
91-180	74,4	31,7	0,0	0,0	31,7	74,4	0,0
>180	134,8	35,9	0,0	10,0	5,9	94,8	30,0
Total	1300,6	1081,8	568,4	261,2	289,9	815,9	223,5

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

*Incluye solo operaciones interbancarias

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.

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	20 al 24 de enero				27 al 31 de enero				3 al 7 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	103	2839	2918	13	58	2344	2451	7	84	1934	2013
Intragruppo y off-shore***	0	0	1370	562	0	0	1248	446	0	0	1008	286
Otros	103	17	542	1272	58	13	482	1177	84	7	327	970
Total	120	120	4751	4751	71	71	4075	4075	91	91	3269	3269

* 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.