

Fecha de Publicación: 24 de enero de 2014

Fecha de Información: 22 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\$1764,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	569,5	123,8	0,0	259,0	30,8	217,5	93,0
15-35	290,0	575,4	520,5	172,4	8,4	71,2	46,5
36-60	36,2	61,9	20,0	0,0	40,7	35,0	1,2
61-90	51,3	39,5	0,0	40,0	39,5	11,3	0,0
91-180	2,6	70,1	0,0	0,0	70,1	2,6	0,0
>180	39,8	52,3	10,7	0,0	34,7	32,8	7,0
Total	989,4	923,2	551,2	471,4	224,3	370,3	147,7

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

*Incluye solo operaciones interbancarias

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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**	18	100	3087	2917	14	59	2598	2521	7	85	1999	2073
Intragrupa y off-shore***	0	0	1370	809	0	0	1248	454	0	0	1014	290
Otros	100	18	542	1272	59	14	507	1379	85	7	333	982
Total	118	118	4999	4999	73	73	4354	4354	92	92	3345	3345

* 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.

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.