

Fecha de Publicación: 27 de enero de 2014

Fecha de Información: 23 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\$1360,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	268,2	180,5	46,0	54,0	9,7	89,4	124,8
15-35	262,0	605,6	423,0	51,1	55,6	83,9	127,0
36-60	71,2	30,9	0,0	0,0	30,9	71,2	0,0
61-90	30,1	23,0	20,0	0,0	3,0	30,1	0,0
91-180	19,0	6,9	0,0	1,8	6,9	17,2	0,0
>180	82,5	52,6	0,0	0,7	32,6	61,7	20,0
Total	732,9	899,3	489,0	107,6	138,6	353,5	271,8

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

*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

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**	18	100	3141	2972	12	64	2655	2572	7	85	2157	2195
Intragrupa y off-shore***	0	0	1370	809	0	0	1274	477	0	0	1034	321
Otros	100	18	542	1272	64	12	513	1393	85	7	385	1059
Total	118	118	5053	5053	77	77	4443	4443	92	92	3575	3575

* 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.