

Fecha de Publicación: 28 de enero de 2014

Fecha de Información: 24 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\$1207,1 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	195,2	128,7	28,0	54,5	20,7	60,7	80,0
15-35	370,0	467,7	276,3	217,9	81,9	42,7	109,5
36-60	38,7	15,2	0,0	2,5	15,2	36,2	0,0
61-90	52,4	48,0	0,0	0,0	8,0	12,4	40,0
91-180	29,3	18,2	0,0	0,0	18,2	29,3	0,0
>180	56,0	63,0	10,0	0,6	7,3	9,7	45,7
Total	741,5	740,8	314,3	275,4	151,2	190,9	275,2

* 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	3,2 %	5,9 %	2,7 %	3,5 %
15-35	3,3 %	3,5 %	3,6 %	3,5 %
36-60	-	3,8 %	3,1 %	3,3 %
61-90	0,8 %	4,0 %	3,0 %	1,7 %
91-180	-	3,7 %	3,0 %	3,3 %
>180	3,3 %	3,4 %	2,6 %	3,2 %
Total	2,9 %	3,8 %	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	3141	2972	13	66	2768	2642	7	85	2239	2252
Intragrupa y off-shore***	0	0	1370	809	0	0	1302	532	0	0	1034	321
Otros	100	18	541	1272	66	13	529	1426	85	7	387	1087
Total	118	118	5052	5052	78	78	4600	4600	93	93	3660	3660

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.