

Fecha de Publicación: 29 de enero de 2014

Fecha de Información: 27 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\$1003,6 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	336,5	166,0	27,0	155,0	5,0	47,5	134,0
15-35	193,7	279,7	201,5	114,0	21,1	22,7	57,0
36-60	74,4	99,5	52,5	0,0	42,0	69,4	5,0
61-90	10,8	13,5	0,0	0,0	8,5	5,8	5,0
91-180	8,0	4,0	0,0	0,0	4,0	8,0	0,0
>180	6,9	11,6	0,0	0,0	11,6	6,9	0,0
Total	630,3	574,3	281,0	269,0	92,3	160,3	201,0

* 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	3,8 %	3,5 %	3,8 %	3,8 %
15-35	3,2 %	3,5 %	2,9 %	3,2 %
36-60	3,3 %	3,4 %	3,1 %	3,3 %
61-90	3,3 %	3,8 %	2,1 %	3,2 %
91-180	-	3,9 %	2,9 %	3,3 %
>180	-	3,3 %	3,1 %	3,2 %
Total	3,6 %	3,4 %	3,3 %	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	27 al 31 de enero				3 al 7 de febrero				10 al 14 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	67	2993	2746	7	86	2327	2311	25	103	3120	2688
Intragrupa y off-shore***	0	0	1327	662	0	0	1036	336	0	0	1548	1097
Otros	67	13	529	1442	86	7	390	1104	103	25	458	1341
Total	80	80	4849	4849	93	93	3752	3752	128	128	5126	5126

* 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.