

Fecha de Publicación: 3 de febrero de 2014

Fecha de Información: 30 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\$1656,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	191,7	196,2	96,0	76,2	37,7	53,0	62,5
15-35	486,0	425,0	330,3	241,3	12,8	162,9	81,9
36-60	72,1	85,2	0,0	8,0	85,2	64,0	0,0
61-90	63,0	54,4	0,0	0,0	9,4	18,0	45,0
91-180	47,0	35,8	1,1	0,0	4,7	17,0	30,0
>180	77,5	213,9	95,0	0,0	46,9	5,5	72,0
Total	937,2	1010,5	522,4	325,5	196,8	320,3	291,4

* 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	0,8 %	3,2 %	3,1 %	2,5 %
15-35	2,3 %	3,3 %	3,0 %	3,1 %
36-60	-	3,4 %	3,1 %	3,3 %
61-90	0,0 %	1,8 %	2,3 %	0,8 %
91-180	0,0 %	3,6 %	3,0 %	1,3 %
>180	3,2 %	2,9 %	3,0 %	3,0 %
Total	1,6 %	3,2 %	3,0 %	2,8 %

*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	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**	12	68	3719	3233	12	77	2790	2629	25	104	3574	3053
Intragruppo y off-shore***	0	0	1434	1035	0	1	1151	459	0	0	1711	1099
Otros	68	12	566	1451	77	10	425	1277	104	25	528	1660
Total	80	80	5719	5719	89	89	4365	4365	129	129	5812	5812

* 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.