

Fecha de Publicación: 10 de enero de 2014

Fecha de Información: 08 de enero de 2014¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1061,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	275,4	117,0	49,5	185,5	10,5	32,9	57,0
15-35	222,3	323,5	276,3	32,5	45,6	188,1	1,7
36-60	72,8	109,7	0,0	0,0	69,1	32,3	40,6
61-90	6,1	5,9	0,0	0,0	0,9	1,1	5,0
91-180	7,3	5,8	0,0	0,0	0,8	2,3	5,0
>180	2,2	23,0	0,0	0,0	23,0	2,2	0,0
Total	586,1	584,8	325,8	218,0	149,9	258,9	109,2

* 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	
3-14	1,8 %	2,8 %	1,7 %	1,9 %
15-35	3,1 %	3,1 %	2,8 %	3,0 %
36-60	2,8 %	3,4 %	2,7 %	3,1 %
61-90	3,1 %	3,0 %	2,7 %	3,1 %
91-180	3,3 %	3,7 %	2,8 %	3,2 %
>180	-	3,3 %	2,9 %	3,3 %
Total	2,3 %	3,1 %	2,3 %	2,7 %

*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	6 al 10 de enero				13 al 17 de enero				20 al 24 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	54	63	3611	4084	52	139	3163	3116	5	169	1910	2273
Intragrupo y off-shore***	0	0	2430	1574	0	1	1813	1019	0	0	1104	247
Otros	63	54	511	893	139	51	442	1282	169	5	445	939
Total	117	117	6551	6551	192	192	5417	5417	174	174	3459	3459

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.