

Fecha de Publicación: 5 de febrero de 2014

Fecha de Información: 03 de febrero 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\$1264,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	260,5	264,5	86,5	97,5	63,7	48,7	114,3
15-35	344,4	291,3	179,3	81,5	19,7	170,6	92,3
36-60	97,2	57,8	25,0	35,0	32,8	62,2	0,0
61-90	32,0	40,4	35,0	0,0	5,4	32,0	0,0
91-180	11,4	27,8	0,0	0,3	27,8	11,0	0,0
>180	36,9	7,0	0,5	1,5	6,5	35,3	0,0
Total	782,2	688,7	326,3	215,9	155,9	359,7	206,6

* 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	0,6 %	2,3 %	0,0 %	1,0 %
15-35	1,5 %	2,0 %	1,6 %	1,7 %
36-60	-	2,7 %	2,1 %	2,3 %
61-90	-	2,6 %	2,1 %	2,4 %
91-180	-	2,9 %	2,3 %	2,7 %
>180	-	3,5 %	2,8 %	2,9 %
Total	1,0 %	2,3 %	1,5 %	1,7 %

*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	3 al 7 de febrero				10 al 14 de febrero				17 al 21 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	79	3048	2840	37	103	3736	3254	23	59	2002	3066
Intragruppo y off-shore***	0	1	1210	540	0	0	1808	1186	0	0	2128	503
Otros	79	11	449	1326	103	37	577	1680	59	23	353	913
Total	92	92	4706	4706	140	140	6120	6120	82	82	4483	4483

* 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.