

Fecha de Publicación: 6 de febrero de 2014

Fecha de Información: 04 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\$1641,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,2%.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	353,5	281,7	102,5	190,5	24,7	8,5	154,5
15-35	553,9	399,3	253,0	304,0	62,3	165,9	84,0
36-60	22,2	64,0	32,0	0,0	32,0	22,2	0,0
61-90	47,0	33,5	0,0	30,0	23,5	7,0	10,0
91-180	10,5	33,2	0,0	0,0	23,2	0,5	10,0
>180	50,9	70,2	22,0	0,0	28,2	30,9	20,0
Total	1037,9	881,9	409,5	524,5	193,9	234,9	278,5

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

*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	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	68	3282	2956	37	106	3850	3424	23	60	2124	3137
Intragrupa y off-shore***	0	1	1247	717	0	0	1873	1199	0	0	2160	536
Otros	68	12	473	1328	106	37	585	1686	60	23	358	968
Total	81	81	5001	5001	144	144	6309	6309	83	83	4641	4641

* 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.