

Fecha de Publicación: 7 de febrero de 2014

Fecha de Información: 05 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\$1743,9 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	236,5	112,1	37,0	122,0	20,1	59,5	55,0
15-35	539,0	583,6	425,7	383,0	78,5	76,5	79,5
36-60	73,3	91,5	85,0	0,0	6,5	73,3	0,0
61-90	13,6	3,1	0,0	0,0	3,1	13,6	0,0
91-180	0,3	9,9	0,0	0,0	9,9	0,3	0,0
>180	116,3	107,1	90,0	0,0	9,1	108,3	8,0
Total	979,0	907,3	637,7	505,0	127,2	331,5	142,5

* 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	0,8 %	1,5 %	0,5 %	0,8 %
15-35	1,3 %	1,8 %	1,4 %	1,6 %
36-60	-	2,0 %	1,6 %	1,8 %
61-90	-	4,3 %	1,5 %	2,0 %
91-180	-	3,3 %	2,0 %	3,3 %
>180	2,9 %	3,1 %	2,8 %	2,9 %
Total	1,2 %	2,0 %	1,4 %	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	74	3408	2966	38	108	3951	3454	23	60	2216	3182
Intragruppo y off-shore***	0	1	1259	829	0	0	1898	1209	0	0	2160	604
Otros	74	12	471	1342	108	38	536	1722	60	23	403	992
Total	87	87	5137	5137	146	146	6385	6385	83	83	4779	4779

* 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.