

Fecha de Publicación: 10 de febrero de 2014

Fecha de Información: 06 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\$1569,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.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	270,5	194,6	131,0	150,0	38,6	95,5	25,0
15-35	584,5	444,2	292,5	297,3	20,3	155,9	131,4
36-60	64,8	31,3	0,0	0,0	31,3	64,8	0,0
61-90	2,3	6,7	0,0	0,0	6,7	2,3	0,0
91-180	23,9	16,7	0,0	0,0	16,7	23,9	0,0
>180	59,3	36,5	0,0	10,0	26,5	39,3	10,0
Total	1005,4	730,1	423,5	457,3	140,2	381,7	166,4

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

*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	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	75	3536	3058	38	102	4048	3530	24	61	2277	3224
Intragrupa y off-shore***	0	1	1339	937	0	0	1924	1245	0	0	2185	610
Otros	75	12	472	1352	102	38	570	1768	61	24	405	1032
Total	88	88	5347	5347	140	140	6542	6542	85	85	4866	4866

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.