

Fecha de Publicación: 11 de febrero de 2014

Fecha de Información: 07 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\$1981,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,4%.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	447,6	335,9	101,0	182,0	82,9	113,6	152,0
15-35	572,9	560,4	469,5	487,4	57,7	52,4	33,2
36-60	2,9	84,4	35,0	0,0	49,4	2,9	0,0
61-90	65,6	40,8	11,1	0,0	4,7	40,6	25,0
91-180	29,0	44,1	15,0	0,7	24,1	23,3	5,0
>180	10,9	12,0	0,0	0,0	2,0	0,9	10,0
Total	1129,0	1077,6	631,6	670,1	220,9	233,7	225,2

* 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	Compras	Ventas	
3-14	-0,1 %	0,5 %	0,1 %	0,2 %
15-35	-1,3 %	0,5 %	0,1 %	0,2 %
36-60	-	1,5 %	0,3 %	1,5 %
61-90	1,6 %	1,6 %	2,1 %	1,8 %
91-180	2,6 %	2,5 %	2,4 %	2,5 %
>180	2,9 %	3,2 %	-0,1 %	2,8 %
Total	0,1 %	0,7 %	0,3 %	0,4 %

*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	72	3538	3059	38	107	4418	3780	24	59	2353	3307
Intragrupa y off-shore***	0	1	1339	937	0	0	2006	1408	0	0	2204	629
Otros	72	12	473	1354	107	38	617	1852	59	24	439	1059
Total	85	85	5349	5349	145	145	7041	7041	83	83	4995	4995

* 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.