

Fecha de Publicación: 12 de febrero de 2014

Fecha de Información: 10 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\$1642,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	432,2	349,4	196,6	191,7	42,8	130,5	110,0
15-35	395,2	287,4	182,0	275,0	34,4	49,2	71,0
36-60	106,0	55,7	1,3	0,0	54,4	106,0	0,0
61-90	40,0	4,1	0,0	20,0	1,3	17,2	2,8
91-180	40,0	108,7	0,0	10,0	108,7	30,0	0,0
>180	5,1	2,5	0,0	0,0	2,5	5,1	0,0
Total	1018,5	807,7	379,9	496,7	244,0	338,0	183,8

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

*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	10 al 14 de febrero				17 al 21 de febrero				24 al 28 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	38	112	4713	4044	24	61	2462	3346	19	105	2840	3629
Intragrupo y off-shore***	5	0	2158	1562	0	0	2204	657	0	0	2113	1290
Otros	107	38	644	1908	61	24	453	1115	105	19	613	648
Total	150	150	7514	7514	85	85	5119	5119	124	124	5567	5567

* 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.