

Fecha de Publicación: 13 de febrero de 2014

Fecha de Información: 11 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\$1626,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,6%.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	382,2	121,3	42,0	259,5	29,3	72,7	50,0
15-35	514,3	504,9	416,5	353,5	44,4	116,8	44,0
36-60	0,9	86,9	0,0	0,0	86,9	0,9	0,0
61-90	11,6	4,7	0,7	1,2	4,0	10,4	0,0
91-180	0,1	15,0	0,0	0,0	15,0	0,1	0,0
>180	60,1	58,8	0,0	13,0	18,8	7,1	40,0
Total	969,2	791,6	459,2	627,2	198,5	208,0	134,0

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

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

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	109	4839	4120	24	62	2622	3368	19	106	3078	3763
Intragrupoy off-shore***	5	0	2199	1648	0	0	2205	815	0	0	2214	1400
Otros	104	38	649	1918	62	24	474	1117	106	19	622	751
Total	147	147	7687	7687	86	86	5301	5301	125	125	5914	5914

* 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.