

Fecha de Publicación: 14 de febrero de 2014

Fecha de Información: 12 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\$2175,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.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	590,3	220,2	97,7	417,2	33,5	84,1	89,0
15-35	377,0	563,8	466,5	267,8	67,3	79,3	30,0
36-60	123,1	79,5	17,5	0,0	32,0	93,1	30,0
61-90	48,3	48,5	35,9	0,4	12,5	47,9	0,0
91-180	146,6	40,8	0,0	0,0	40,8	146,6	0,0
>180	80,2	76,6	0,0	0,0	6,6	10,2	70,0
Total	1365,5	1029,3	617,6	685,3	192,7	461,2	219,0

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

*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	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**	28	101	5161	4193	24	69	2857	3472	20	107	3121	3828
Intragrupa y off-shore***	0	0	2209	1885	5	0	2265	996	0	0	2261	1400
Otros	101	28	637	1929	63	24	502	1157	107	20	640	794
Total	129	129	8007	8007	93	93	5625	5625	127	127	6022	6022

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