

Fecha de Publicación: 17 de febrero de 2014

Fecha de Información: 13 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\$1536,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,0%.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	337,9	182,8	88,0	162,5	10,8	91,4	84,0
15-35	401,5	421,8	284,5	162,0	41,3	143,5	96,0
36-60	31,3	64,5	0,0	0,0	64,5	31,3	0,0
61-90	21,4	7,5	0,0	1,0	7,5	20,4	0,0
91-180	157,0	217,2	25,0	0,0	53,2	18,0	139,0
>180	9,9	7,6	0,0	0,0	2,6	4,9	5,0
Total	958,9	901,3	397,5	325,5	179,8	309,4	324,0

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

*Incluye solo operaciones interbancarias

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.

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	99	5273	4270	25	71	3079	3522	21	113	3180	3885
Intragruppo y off-shore***	0	0	2231	1940	5	0	2285	1104	0	0	2317	1445
Otros	99	28	638	1932	65	25	503	1242	113	21	641	808
Total	128	128	8142	8142	95	95	5868	5868	133	133	6138	6138

* 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.