

Fecha de Publicación: 18 de febrero de 2014

Fecha de Información: 14 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\$1303,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.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	328,1	249,2	37,5	101,5	67,5	82,4	144,2
15-35	596,2	176,0	71,0	302,8	37,7	226,2	67,3
36-60	38,6	47,5	21,5	0,0	11,0	23,6	15,0
61-90	25,5	10,9	2,7	1,3	8,3	24,2	0,0
91-180	10,5	43,5	0,0	0,0	43,5	10,5	0,0
>180	0,8	3,1	0,0	0,0	3,1	0,8	0,0
Total	999,7	530,3	132,7	405,6	171,1	367,7	226,5

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

*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	98	5272	4270	24	71	3246	3667	21	117	3341	3984
Intragrupa y off-shore***	0	0	2231	1940	5	0	2301	1158	0	0	2339	1492
Otros	98	28	638	1931	66	24	537	1259	117	21	669	873
Total	126	126	8141	8141	95	95	6085	6085	138	138	6348	6348

* 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.