

Fecha de Publicación: 19 de febrero de 2014

Fecha de Información: 17 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\$167,5 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	59,7	43,1	22,0	36,0	7,1	9,7	14,0
15-35	15,2	27,3	20,6	14,8	6,7	0,4	0,0
36-60	4,8	2,6	0,0	0,0	2,6	4,8	0,0
61-90	1,3	10,1	0,0	0,0	10,1	1,3	0,0
91-180	3,4	10,3	0,4	0,0	9,9	3,4	0,0
>180	1,5	2,3	0,0	0,0	2,3	1,5	0,0
Total	85,8	95,7	43,0	50,8	38,7	21,0	14,0

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

*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	17 al 21 de febrero				24 al 28 de febrero				3 al 7 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	72	3287	3686	21	119	3359	4002	16	88	2751	2684
Intragruppo y off-shore***	5	0	2323	1192	0	0	2339	1494	0	0	1739	1221
Otros	67	24	535	1266	119	21	673	875	88	16	422	1007
Total	96	96	6145	6145	139	139	6371	6371	104	104	4912	4912

* 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.