

Fecha de Publicación: 20 de febrero de 2014

Fecha de Información: 18 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\$1438,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.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	490,0	472,0	295,6	256,0	17,9	75,5	158,5
15-35	175,3	216,7	178,9	118,5	23,9	42,9	14,0
36-60	101,7	74,0	4,6	0,0	69,4	101,7	0,0
61-90	16,6	16,6	0,7	7,8	15,9	8,8	0,0
91-180	25,3	10,1	0,0	22,8	10,1	2,6	0,0
>180	6,7	5,8	0,0	3,6	5,8	3,1	0,0
Total	815,7	795,2	479,8	408,6	143,0	234,6	172,5

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

*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	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**	16	72	3622	3911	22	119	3516	4201	17	88	2821	2774
Intragruppo y off-shore***	5	0	2411	1375	0	0	2499	1567	0	0	1826	1280
Otros	67	16	547	1295	119	22	677	924	88	17	422	1017
Total	88	88	6581	6581	141	141	6692	6692	104	104	5070	5070

* 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.