

Fecha de Publicación: 21 de febrero de 2014

Fecha de Información: 19 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\$1988,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,3%.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	582,2	333,6	205,2	463,1	68,4	59,1	60,0
15-35	255,6	532,4	498,7	163,2	11,7	70,4	22,0
36-60	79,8	125,3	20,1	0,0	105,3	79,8	0,0
61-90	35,5	40,6	40,0	4,8	0,6	30,7	0,0
91-180	0,2	1,6	0,1	0,0	1,5	0,2	0,0
>180	32,8	50,3	50,0	10,0	0,3	22,8	0,0
Total	986,1	1083,9	814,0	641,1	187,8	263,1	82,0

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

*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

Sector	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	70	4036	3962	22	118	3633	4446	17	88	2923	2852
Intragrupa y off-shore***	5	0	2424	1764	0	0	2674	1630	0	0	1883	1326
Otros	65	16	569	1302	118	22	704	935	88	17	444	1072
Total	86	86	7029	7029	141	141	7011	7011	105	105	5250	5250

* 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.