

Fecha de Publicación: 22 de febrero de 2014

Fecha de Información: 20 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\$1638,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	324,4	333,1	122,0	46,0	49,7	117,0	161,4
15-35	379,2	615,5	530,0	90,5	29,5	232,7	56,0
36-60	52,4	11,3	0,0	0,0	11,3	52,4	0,0
61-90	18,3	12,0	0,0	0,0	12,0	18,3	0,0
91-180	20,2	33,9	26,0	0,0	7,9	20,2	0,0
>180	41,2	24,8	0,0	20,0	14,8	11,2	10,0
Total	835,7	1030,5	678,0	156,5	125,1	451,8	227,4

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

*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	74	4085	4001	24	121	3870	4698	17	88	2960	2907
Intragruppo y off-shore***	5	0	2463	1809	0	0	2777	1647	0	0	1907	1326
Otros	68	16	549	1287	121	24	724	1025	88	17	464	1098
Total	90	90	7098	7098	144	144	7370	7370	105	105	5330	5330

* 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.