

Fecha de Publicación: 25 de febrero de 2014

Fecha de Información: 21 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\$1214,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.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	326,6	167,5	112,0	116,0	10,5	165,6	45,0
15-35	248,2	364,4	176,9	49,0	12,5	24,2	175,0
36-60	65,4	2,2	0,0	0,0	2,2	65,4	0,0
61-90	72,4	68,7	25,0	22,0	3,7	10,4	40,0
91-180	18,1	7,4	0,1	10,0	7,2	8,1	0,0
>180	129,5	73,8	0,0	43,0	3,8	16,5	70,0
Total	860,3	684,0	314,0	240,0	40,0	290,3	330,0

* 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	0,0 %	1,8 %	1,6 %	1,5 %
15-35	1,7 %	1,9 %	1,2 %	1,7 %
36-60	-	2,2 %	1,1 %	1,2 %
61-90	2,4 %	2,3 %	1,7 %	2,2 %
91-180	-	2,9 %	1,3 %	2,0 %
>180	2,9 %	3,7 %	2,8 %	2,9 %
Total	1,8 %	1,9 %	1,6 %	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	71	4085	4004	25	124	4130	4789	18	88	3023	2982
Intragruppo y off-shore***	5	0	2463	1809	0	0	2816	1735	0	0	1980	1354
Otros	66	16	551	1287	124	25	730	1151	88	18	465	1133
Total	87	87	7100	7100	148	148	7675	7675	106	106	5468	5468

* 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.