

Fecha de Publicación: 26 de febrero de 2014

Fecha de Información: 24 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\$1739,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	391,1	221,8	124,5	189,0	22,3	127,1	75,0
15-35	478,8	396,5	329,0	323,3	7,5	95,5	60,0
36-60	46,8	177,1	160,0	0,0	17,1	46,8	0,0
61-90	49,5	111,9	55,0	0,0	16,9	9,5	40,0
91-180	0,0	10,2	0,0	0,0	10,2	0,0	0,0
>180	23,5	7,5	0,0	0,0	7,5	23,5	0,0
Total	989,6	924,8	668,5	512,3	81,3	302,4	175,0

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

*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	24 al 28 de febrero				3 al 7 de marzo				10 al 14 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	126	4390	4914	18	88	3144	3074	14	189	2045	2066
Intragrupoy off-shore***	0	0	2867	1888	0	0	2053	1381	0	0	1205	837
Otros	126	25	729	1184	88	18	485	1227	189	14	549	897
Total	150	150	7987	7987	106	106	5682	5682	203	203	3799	3799

* 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.