

Fecha de Publicación: 28 de febrero de 2014

Fecha de Información: 26 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\$1378,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	200,9	198,7	123,0	111,2	15,7	29,7	60,0
15-35	282,2	482,8	413,7	77,0	14,2	150,2	55,0
36-60	20,6	4,6	0,0	0,0	4,6	20,6	0,0
61-90	73,6	114,8	25,0	0,0	79,8	63,6	10,0
91-180	37,5	22,9	20,0	0,0	2,9	37,5	0,0
>180	34,0	60,9	0,0	0,0	30,9	4,0	30,0
Total	648,8	884,7	581,7	188,2	148,1	305,6	155,0

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

*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

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**	22	108	4773	4993	23	89	3327	3597	15	190	2325	2114
Intragrupo y off-shore***	0	0	2933	2254	0	0	2467	1439	0	0	1243	872
Otros	108	22	742	1200	89	23	492	1250	190	15	559	1141
Total	131	131	8448	8448	111	111	6286	6286	204	204	4127	4127

* 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.