

Fecha de Publicación: 5 de marzo de 2014

Fecha de Información: 03 de marzo 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\$1497,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,2%.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	478,7	432,9	140,5	110,5	8,4	84,2	284,0
15-35	359,5	512,4	302,8	111,0	9,4	48,2	200,3
36-60	48,7	36,0	0,0	0,0	11,0	23,7	25,0
61-90	97,8	30,6	0,0	0,0	0,6	67,8	30,0
91-180	2,2	4,8	0,0	0,0	4,8	2,2	0,0
>180	21,8	31,2	10,0	0,0	1,2	1,8	20,0
Total	1008,7	1047,9	453,3	221,5	35,3	227,9	559,3

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

*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	3 al 7 de marzo				10 al 14 de marzo				17 al 21 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	92	3816	3883	22	192	2961	2697	8	81	3011	3566
Intragrupa y off-shore***	0	1	2572	1711	0	0	1420	881	0	0	2610	1375
Otros	92	32	515	1309	192	22	577	1381	81	8	324	1004
Total	125	125	6903	6903	214	214	4958	4958	90	90	5945	5945

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.