

Fecha de Publicación: 6 de marzo de 2014

Fecha de Información: 04 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\$1361,4 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	262,8	339,1	159,5	38,1	27,6	72,7	152,0
15-35	414,1	400,4	217,5	167,5	15,9	79,6	167,0
36-60	36,2	38,2	20,0	0,0	3,2	21,2	15,0
61-90	0,2	74,1	70,0	0,0	4,1	0,2	0,0
91-180	44,3	44,8	25,0	0,0	9,8	34,3	10,0
>180	47,9	28,3	0,0	20,0	3,3	2,9	25,0
Total	805,5	924,9	492,0	225,6	63,9	210,9	369,0

* 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	1,7 %	1,1 %	1,1 %	1,3 %
15-35	1,8 %	1,8 %	1,6 %	1,7 %
36-60	1,9 %	1,2 %	1,4 %	1,5 %
61-90	-	1,8 %	1,6 %	1,8 %
91-180	2,3 %	2,5 %	1,8 %	2,2 %
>180	2,7 %	3,5 %	2,6 %	2,7 %
Total	1,8 %	1,6 %	1,5 %	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	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**	32	91	3917	4000	23	194	3096	2846	9	81	3155	3687
Intragrupoy off-shore***	0	1	2638	1737	0	0	1460	883	0	0	2664	1386
Otros	91	31	517	1334	194	23	598	1426	81	9	330	1077
Total	124	124	7071	7071	217	217	5154	5154	90	90	6150	6150

* 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.