

Fecha de Publicación: 7 de marzo de 2014

Fecha de Información: 05 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\$1297,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,1%.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	234,3	308,4	181,0	56,5	25,4	75,8	102,0
15-35	370,6	371,7	225,0	226,0	25,7	23,5	121,0
36-60	1,6	6,7	0,0	0,0	6,7	1,6	0,0
61-90	90,6	27,6	10,0	0,0	7,6	80,6	10,0
91-180	17,1	17,8	0,0	0,0	17,8	17,1	0,0
>180	27,3	72,2	25,0	10,0	32,2	2,3	15,0
Total	741,5	804,4	441,0	292,5	115,4	200,9	248,0

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

*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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. 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	88	3928	4095	23	196	3233	2990	20	86	3301	3950
Intragrupoy off-shore***	0	1	2730	1744	0	0	1556	932	0	0	2804	1402
Otros	88	31	519	1338	196	23	614	1481	86	20	334	1087
Total	120	120	7177	7177	219	219	5403	5403	106	106	6438	6438

* 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.