

Fecha de Publicación: 10 de marzo de 2014

Fecha de Información: 06 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\$1888,1 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	435,8	482,0	156,0	82,0	60,5	88,3	265,5
15-35	588,1	332,3	231,5	359,5	43,8	171,6	57,0
36-60	27,0	44,4	0,3	2,0	44,2	25,0	0,0
61-90	13,6	132,8	1,2	0,2	131,6	13,4	0,0
91-180	29,7	48,6	0,0	0,5	38,6	19,2	10,0
>180	55,8	45,3	20,0	38,0	10,3	2,8	15,0
Total	1150,1	1085,5	408,9	482,2	329,1	320,4	347,5

* 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	1,9 %	2,5 %	1,2 %	1,8 %
15-35	1,5 %	2,2 %	1,9 %	2,0 %
36-60	-	2,7 %	2,0 %	2,4 %
61-90	-	2,6 %	2,0 %	2,6 %
91-180	2,5 %	3,1 %	1,9 %	2,7 %
>180	2,8 %	3,2 %	2,8 %	2,9 %
Total	1,9 %	2,5 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$. 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	88	4028	4163	23	235	3435	3160	20	90	3510	4166
Intragrupoy off-shore***	0	1	2743	1803	0	0	1581	932	0	0	2935	1440
Otros	88	31	534	1340	235	23	607	1532	90	20	344	1183
Total	119	119	7306	7306	258	258	5623	5623	109	109	6789	6789

* 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.