

Fecha de Publicación: 11 de marzo de 2014

Fecha de Información: 07 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\$820,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	153,5	157,5	104,0	70,1	8,5	38,4	45,0
15-35	248,2	336,8	233,7	57,3	7,1	95,0	96,0
36-60	5,5	3,8	0,0	2,5	3,8	3,0	0,0
61-90	1,1	13,4	0,0	0,0	13,4	1,1	0,0
91-180	0,7	11,3	0,0	0,0	11,3	0,7	0,0
>180	21,3	13,7	5,0	15,0	3,7	1,3	5,0
Total	430,4	536,4	342,7	144,8	47,8	139,6	146,0

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

*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**	32	81	4028	4135	24	232	3526	3243	20	90	3562	4153
Intragrupa y off-shore***	0	1	2716	1803	0	0	1684	942	0	0	2916	1490
Otros	81	31	534	1340	232	24	543	1568	90	20	349	1185
Total	113	113	7278	7278	255	255	5753	5753	109	109	6827	6827

* 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.