

Fecha de Publicación: 12 de marzo de 2014

Fecha de Información: 10 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\$1418,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	401,3	486,2	324,6	253,6	26,4	12,5	135,2
15-35	310,7	236,9	180,2	92,0	6,7	168,7	50,0
36-60	2,3	9,5	0,0	0,0	9,5	2,3	0,0
61-90	60,8	1,8	0,0	0,0	1,8	60,8	0,0
91-180	22,0	13,1	0,0	20,0	13,1	2,0	0,0
>180	11,3	47,5	31,0	0,0	16,5	11,3	0,0
Total	808,4	794,9	535,8	365,6	74,0	257,6	185,2

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

*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	10 al 14 de marzo						17 al 21 de marzo				24 al 28 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V		
Sector Financiero**	28	229	3661	3330	20	91	3824	4552	12	78	1545	1955		
Intragrupa y off-shore***	0	0	1728	1039	0	0	3197	1647	0	0	970	227		
Otros	229	28	546	1566	91	20	372	1194	78	12	565	898		
Total	257	257	5935	5935	110	110	7393	7393	90	90	3080	3080		

* 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.