

Fecha de Publicación: 14 de marzo de 2014

Fecha de Información: 11 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\$1364,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	330,1	447,2	262,4	146,4	32,8	31,7	152,0
15-35	235,0	290,7	269,5	182,0	2,2	34,0	19,0
36-60	25,5	0,5	0,0	0,0	0,5	25,5	0,0
61-90	30,1	7,0	0,0	0,0	7,0	30,1	0,0
91-180	46,3	76,2	70,6	20,0	5,6	26,3	0,0
>180	15,3	36,2	10,0	0,0	21,2	10,3	5,0
Total	682,4	858,0	612,5	348,4	69,5	157,9	176,0

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

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

1

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	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**	31	228	3722	3467	20	91	4081	4847	13	78	1553	2024
Intragrupoy off-shore***	4	0	1821	1060	0	0	3362	1772	0	0	1026	227
Otros	224	31	569	1586	91	20	381	1205	78	13	568	895
Total	259	259	6112	6112	111	111	7824	7824	91	91	3146	3146

* 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.