

Fecha de Publicación: 21 de marzo de 2014

Fecha de Información: 19 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\$3449,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,0%.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	635,1	252,4	63,0	459,0	165,4	152,1	24,0
15-35	1168,5	981,9	797,6	968,8	72,3	87,7	112,0
36-60	63,2	110,8	0,0	0,0	90,8	43,2	20,0
61-90	76,1	112,9	2,8	14,0	110,2	62,1	0,0
91-180	19,9	98,6	0,0	5,0	93,6	9,9	5,0
>180	3,4	89,7	29,5	0,0	58,1	1,4	2,0
Total	1966,2	1646,2	892,9	1446,8	590,3	356,4	163,0

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

*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

Sector	17 al 21 de marzo				24 al 28 de marzo				31 de mar. al 4 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	84	5491	5571	12	99	2101	2365	17	57	2416	2622
Intragrupa y off-shore***	4	0	3872	2904	0	0	1146	351	0	0	1550	973
Otros	80	20	407	1296	99	12	695	1226	57	17	455	826
Total	103	103	9770	9770	111	111	3942	3942	74	74	4421	4421

* 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

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.