

Fecha de Publicación: 26 de marzo de 2014

Fecha de Información: 21 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\$2275,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.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	349,3	187,1	103,0	213,0	28,1	80,3	56,0
15-35	599,2	824,7	475,0	280,0	157,0	126,5	192,8
36-60	53,1	117,2	53,9	16,5	40,5	13,8	22,8
61-90	35,4	58,5	0,0	21,2	58,5	14,2	0,0
91-180	93,0	60,0	0,7	61,0	49,4	22,1	10,0
>180	158,9	40,8	0,0	137,6	20,8	1,3	20,0
Total	1289,0	1288,3	632,5	729,3	354,3	258,2	301,6

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

*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	82	5786	5573	13	105	2385	2580	17	67	2734	2739
Intragrupa y off-shore***	4	0	3872	3197	0	0	1296	540	0	0	1595	1160
Otros	78	20	409	1298	104	13	711	1273	67	17	498	929
Total	101	101	10067	10067	118	118	4393	4393	84	84	4827	4827

* 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.