

Fecha de Publicación: 27 de marzo de 2014

Fecha de Información: 25 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\$2432,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	521,9	306,4	159,0	248,6	22,4	148,3	125,0
15-35	277,1	697,7	510,5	89,5	72,2	72,6	115,0
36-60	74,9	50,4	1,6	45,0	28,8	9,9	20,0
61-90	27,6	339,9	191,3	0,0	127,6	6,6	21,0
91-180	213,2	70,4	0,5	180,0	69,9	33,2	0,0
>180	26,9	122,1	10,2	5,0	96,9	6,9	15,0
Total	1141,6	1586,8	873,0	568,1	417,8	277,5	296,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,9 %	2,3 %	1,0 %	1,6 %
15-35	1,4 %	1,3 %	0,9 %	1,2 %
36-60	2,1 %	2,1 %	1,7 %	1,9 %
61-90	1,8 %	2,4 %	1,6 %	2,3 %
91-180	-	2,9 %	2,4 %	2,6 %
>180	3,0 %	3,2 %	2,9 %	3,2 %
Total	1,8 %	2,0 %	1,4 %	1,8 %

*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	24 al 28 de marzo				31 de mar. al 4 de abril				7 al 11 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	105	2478	2743	19	68	3130	2848	32	132	2297	2212
Intragruppo y off-shore***	0	0	1408	583	0	0	1632	1358	0	0	1296	876
Otros	105	13	717	1278	68	19	511	1067	132	32	334	839
Total	119	119	4604	4604	87	87	5273	5273	164	164	3926	3926

* 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 intragruppo.