

Fecha de Publicación: 28 de marzo de 2014

Fecha de Información: 26 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\$1654,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	286,0	273,9	170,0	89,0	24,2	117,3	79,7
15-35	591,7	337,8	120,6	140,5	16,9	250,9	200,3
36-60	198,4	144,0	0,8	0,9	18,6	72,9	124,6
61-90	97,1	34,5	0,0	0,0	34,5	97,1	0,0
91-180	12,7	39,3	0,0	0,0	39,3	12,7	0,0
>180	22,4	41,5	0,0	0,0	21,5	2,4	20,0
Total	1208,3	871,0	291,4	230,4	155,0	553,3	424,5

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

*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**	14	101	2518	2805	19	70	3346	3049	32	133	2483	2260
Intragruppo y off-shore***	0	0	1453	613	0	0	1750	1398	0	0	1303	895
Otros	101	14	725	1277	70	19	523	1173	133	32	340	971
Total	115	115	4696	4696	89	89	5620	5620	165	165	4126	4126

* 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.