

Fecha de Publicación: 1 de abril de 2014

Fecha de Información: 28 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\$1480,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	298,2	311,0	162,5	68,1	9,5	91,1	139,0
15-35	448,3	472,4	203,4	161,0	84,0	102,3	185,0
36-60	58,2	9,0	1,2	0,5	7,9	57,7	0,0
61-90	22,0	86,1	0,0	15,0	81,6	2,5	4,5
91-180	24,5	27,1	0,0	0,0	27,1	24,5	0,0
>180	39,0	32,8	0,0	0,0	12,8	19,0	20,0
Total	890,2	938,4	367,0	244,6	222,9	297,1	348,5

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

*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	100	2524	2827	21	72	3740	3486	35	135	2688	2372
Intragruppo y off-shore***	0	0	1465	613	0	0	1983	1532	0	0	1338	904
Otros	100	14	730	1279	72	21	549	1253	135	35	348	1098
Total	114	114	4719	4719	92	92	6271	6271	170	170	4373	4373

* 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.