

Fecha de Publicación: 2 de abril de 2014

Fecha de Información: 31 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\$1471,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	252,9	208,2	0,0	44,0	68,9	69,6	139,3
15-35	594,5	523,8	131,7	327,0	171,6	47,0	220,5
36-60	63,3	70,0	0,0	19,0	69,8	44,1	0,2
61-90	16,4	33,6	19,0	4,3	14,6	12,1	0,0
91-180	2,9	27,1	0,0	0,0	27,1	2,9	0,0
>180	32,2	6,9	0,0	30,0	6,9	2,2	0,0
Total	962,1	869,6	150,7	424,3	359,0	177,9	360,0

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

*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

Sectores	31 de mar. al 4 de abril				7 al 11 de abril				14 al 18 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	74	69	3815	3559	35	136	2817	2448	8	91	2421	2743
Intragrupa y off-shore***	0	0	1983	1569	0	0	1338	907	0	0	1647	1478
Otros	69	74	558	1227	136	35	349	1149	91	8	529	374
Total	143	143	6355	6355	171	171	4503	4503	98	98	4596	4596

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.