

Fecha de Publicación: 3 de abril de 2014

Fecha de Información: 01 de abril 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\$1282,0 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	123,1	254,0	156,0	47,2	29,0	6,9	69,0
15-35	398,6	417,0	333,6	114,8	15,4	215,8	68,0
36-60	36,8	51,4	8,7	0,9	23,9	17,1	18,8
61-90	68,3	20,8	0,0	0,0	20,8	68,3	0,0
91-180	5,4	33,0	0,0	0,0	32,4	4,7	0,7
>180	24,5	16,5	0,0	10,0	5,5	3,5	11,0
Total	656,6	792,8	498,4	172,8	127,0	316,4	167,4

* 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	1,6 %	5,2 %	1,6 %	3,4 %
15-35	2,2 %	2,8 %	2,6 %	2,7 %
36-60	2,8 %	6,4 %	2,5 %	4,4 %
61-90	-	7,2 %	2,3 %	3,5 %
91-180	3,0 %	3,5 %	2,9 %	3,4 %
>180	3,0 %	3,6 %	3,1 %	3,1 %
Total	2,1 %	3,8 %	2,5 %	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**	76	69	3892	3663	36	138	2861	2569	8	91	2421	2771
Intragrupa y off-shore***	0	0	2052	1614	0	1	1398	908	0	0	1674	1478
Otros	69	76	564	1230	138	35	369	1152	90	8	530	375
Total	144	144	6508	6508	174	174	4628	4628	99	99	4624	4624

* 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.