

Fecha de Publicación: 7 de abril de 2014

Fecha de Información: 03 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\$1247,1 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	107,4	113,4	65,5	49,5	1,9	11,9	46,0
15-35	312,4	597,5	478,0	66,0	21,5	148,4	98,0
36-60	19,6	23,8	0,0	0,0	23,8	19,6	0,0
61-90	78,6	38,3	0,0	50,0	38,3	28,6	0,0
91-180	36,6	15,4	0,0	0,0	15,4	36,6	0,0
>180	23,1	25,1	0,5	20,5	24,6	2,6	0,0
Total	577,6	813,5	544,0	186,0	125,5	247,6	144,0

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

Sector	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**	75	70	3990	3796	36	135	2989	2661	8	91	2464	2835
Intragrupa y off-shore***	0	0	2163	1687	0	1	1442	961	0	0	1729	1508
Otros	70	75	563	1233	135	34	371	1180	91	8	538	388
Total	145	145	6715	6715	171	171	4802	4802	99	99	4731	4731

* 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.