

Fecha de Publicación: 9 de abril de 2014

Fecha de Información: 07 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\$1592,6 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	199,0	238,8	199,7	110,0	18,1	68,0	21,0
15-35	621,1	406,7	204,0	302,1	10,7	127,0	192,0
36-60	85,5	13,7	2,4	1,6	11,3	83,9	0,0
61-90	12,5	86,0	0,0	0,0	86,0	12,5	0,0
91-180	19,1	53,0	1,4	3,4	41,7	5,7	10,0
>180	49,9	35,3	0,0	28,8	30,3	16,0	5,0
Total	987,0	833,6	407,5	446,0	198,1	313,0	228,0

* 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	4,1 %	3,1 %	2,5 %	2,9 %
15-35	3,0 %	3,0 %	2,9 %	2,9 %
36-60	-	3,6 %	2,9 %	3,0 %
61-90	-	3,6 %	2,9 %	3,5 %
91-180	3,2 %	3,4 %	3,0 %	3,3 %
>180	3,4 %	3,0 %	3,3 %	3,2 %
Total	3,1 %	3,2 %	2,8 %	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	7 al 11 de abril				14 al 18 de abril				21 al 25 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	42	141	3244	2911	8	92	2569	2984	14	204	3172	3183
Intragrupa y off-shore***	0	1	1599	1094	0	0	1869	1508	0	0	1794	1174
Otros	141	41	388	1226	91	8	535	480	204	14	481	1090
Total	183	183	5231	5231	100	100	4973	4973	218	218	5447	5447

* 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.