

Fecha de Publicación: 11 de abril de 2014

Fecha de Información: 09 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\$1445,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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 | 248,4 | 166,4 | 127,0 | 191,9 | 3,4 | 20,5 | 36,0 |
| 15-35 | 393,4 | 486,6 | 292,5 | 171,9 | 21,1 | 48,5 | 173,0 |
| 36-60 | 118,5 | 8,5 | 0,2 | 0,0 | 8,3 | 118,5 | 0,0 |
| 61-90 | 50,1 | 21,2 | 5,0 | 0,0 | 16,2 | 50,1 | 0,0 |
| 91-180 | 11,8 | 24,2 | 10,0 | 11,2 | 14,2 | 0,6 | 0,0 |
| >180 | 95,8 | 114,4 | 19,0 | 10,0 | 10,4 | 0,8 | 85,0 |
| Total | 917,9 | 821,2 | 453,7 | 385,0 | 73,6 | 238,9 | 294,0 |

* 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 intragruppo | | Total |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 1,8 % | 3,2 % | 2,3 % | 2,5 % |
| 15-35 | 2,5 % | 2,9 % | 2,4 % | 2,6 % |
| 36-60 | - | 3,6 % | 2,7 % | 2,8 % |
| 61-90 | - | 3,4 % | 2,7 % | 2,9 % |
| 91-180 | - | 4,1 % | 3,0 % | 3,6 % |
| >180 | 3,4 % | 3,5 % | 3,4 % | 3,4 % |
| Total | 2,6 % | 3,1 % | 2,5 % | 2,7 % |

*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 | 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** | 43 | 136 | 3477 | 2982 | 8 | 159 | 2614 | 3068 | 21 | 208 | 3289 | 3384 | | |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 1 | 1646 | 1298 | 0 | 0 | 1977 | 1510 | 0 | 0 | 1887 | 1197 | | |
| Otros | 136 | 42 | 412 | 1255 | 159 | 8 | 475 | 488 | 208 | 21 | 525 | 1119 | | |
| Total | 179 | 179 | 5535 | 5535 | 167 | 167 | 5066 | 5066 | 229 | 229 | 5700 | 5700 | | |

* 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.