

Fecha de Publicación: 14 de abril de 2014

Fecha de Información: 10 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\$1463,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	274,2	448,2	217,5	21,5	26,7	48,7	204,0
15-35	345,3	458,0	284,9	55,5	20,2	136,8	153,0
36-60	26,9	31,2	0,0	0,0	30,8	26,5	0,4
61-90	7,2	24,1	0,0	0,6	23,7	6,2	0,4
91-180	114,2	89,6	0,0	50,0	29,6	4,2	60,0
>180	27,1	37,3	5,7	5,0	29,6	20,1	2,0
Total	794,9	1088,4	508,1	132,6	160,5	242,5	419,8

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

*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	137	3510	3027	10	159	2683	3141	22	212	3461	3701
Intragruppo y off-shore***	0	1	1652	1298	0	0	2008	1522	0	0	2067	1207
Otros	137	41	421	1258	158	10	466	494	212	22	538	1158
Total	180	180	5583	5583	168	168	5157	5157	234	234	6066	6066

* 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.