

Fecha de Publicación: 15 de abril de 2014

Fecha de Información: 11 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\$1098,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	142,2	183,8	51,0	32,0	59,8	37,2	73,0
15-35	507,8	357,8	129,8	130,5	34,1	183,3	194,0
36-60	21,7	35,3	0,0	0,0	35,3	21,7	0,0
61-90	6,3	8,2	0,0	0,0	8,2	6,3	0,0
91-180	20,8	18,2	0,0	1,8	18,2	19,0	0,0
>180	40,3	52,9	20,0	0,0	2,9	10,3	30,0
Total	739,0	656,3	200,8	164,3	158,6	277,7	297,0

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

*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**	42	138	3522	3040	10	157	2768	3220	23	220	3514	3799
Intragruppo y off-shore***	0	1	1652	1298	0	0	2034	1549	0	0	2092	1212
Otros	138	41	434	1270	156	10	466	500	220	23	591	1186
Total	180	180	5608	5608	167	167	5268	5268	243	243	6197	6197

* 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.