

Fecha de Publicación: 16 de abril de 2014

Fecha de Información: 14 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\$821,2 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	180,3	43,2	30,5	147,3	2,7	23,1	10,0
15-35	111,1	383,3	293,1	90,0	78,2	9,1	12,0
36-60	19,3	18,9	10,0	0,0	8,4	18,8	0,5
61-90	1,5	20,6	0,4	0,0	20,3	1,5	0,0
91-180	19,2	20,8	10,0	2,0	10,3	16,7	0,5
>180	22,0	16,0	0,0	10,0	4,0	0,0	12,0
Total	353,5	502,8	344,0	249,3	123,8	69,2	35,0

* 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	3,3 %	2,7 %	3,0 %	2,9 %
15-35	3,2 %	3,0 %	1,8 %	2,7 %
36-60	2,6 %	3,5 %	3,1 %	3,3 %
61-90	-	3,6 %	2,5 %	3,5 %
91-180	3,6 %	3,8 %	3,2 %	3,5 %
>180	3,4 %	3,8 %	3,5 %	3,5 %
Total	3,3 %	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	14 al 18 de abril				21 al 25 de abril				28 de abr. al 2 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	151	2917	3232	23	220	3539	3829	10	80	2400	3176
Intragruppo y off-shore***	0	0	2045	1695	0	0	2112	1213	0	0	1539	829
Otros	151	11	468	502	220	23	591	1200	79	10	508	442
Total	162	162	5429	5429	243	243	6242	6242	90	90	4447	4447

* 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.