

Fecha de Publicación: 21 de abril de 2014

Fecha de Información: 15 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\$1263,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	163,3	108,1	65,3	118,1	22,8	25,2	20,0
15-35	316,7	621,0	456,2	66,0	57,3	143,2	107,5
36-60	22,6	1,6	0,0	0,0	1,6	22,6	0,0
61-90	14,7	35,7	0,0	0,0	35,7	14,7	0,0
91-180	13,8	28,8	23,5	0,0	5,3	13,8	0,0
>180	10,3	56,4	40,0	0,0	13,9	7,8	2,5
Total	541,5	851,6	585,0	184,1	136,6	227,4	130,0

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

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	152	2917	3233	24	221	3697	3915	11	79	2416	3274
Intragruppo y off-shore***	0	0	2045	1695	0	0	2160	1331	0	0	1630	829
Otros	152	11	468	502	221	24	609	1220	79	11	514	458
Total	163	163	5429	5429	244	244	6466	6466	90	90	4561	4561

* 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.