

Fecha de Publicación: 22 de abril de 2014

Fecha de Información: 16 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\$870,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.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	150,7	314,7	155,0	33,0	51,7	9,7	108,0
15-35	224,4	208,7	102,0	39,8	19,7	97,7	87,0
36-60	38,3	36,8	0,0	0,0	1,8	3,3	35,0
61-90	2,8	34,9	30,2	0,0	4,7	2,8	0,0
91-180	25,5	29,5	0,0	20,0	29,5	5,5	0,0
>180	31,0	3,1	0,1	30,0	2,9	1,0	0,0
Total	472,7	627,7	287,3	122,8	110,4	120,0	230,0

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

*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	150	2917	3233	25	228	3844	4170	11	80	2430	3334
Intragruppo y off-shore***	0	0	2045	1695	0	0	2310	1364	0	0	1645	837
Otros	150	11	468	502	228	25	606	1225	79	11	560	464
Total	161	161	5430	5430	252	252	6760	6760	90	90	4635	4635

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.