

Fecha de Publicación: 29 de abril de 2014

Fecha de Información: 25 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\$1141,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	196,1	230,6	144,0	78,5	14,6	45,6	72,0
15-35	243,9	363,4	267,4	135,0	9,5	22,4	86,5
36-60	10,2	13,7	0,0	0,0	13,7	10,2	0,0
61-90	8,4	42,6	1,0	0,0	41,6	8,4	0,0
91-180	50,5	79,2	40,0	0,0	39,2	50,5	0,0
>180	55,8	50,4	0,0	0,0	5,4	10,8	45,0
Total	565,0	779,9	452,4	213,5	124,0	148,0	203,5

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

*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	21 al 25 de abril				28 de abr. al 2 de mayo				5 al 9 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	232	4135	4367	16	81	2857	3751	6	75	2615	2254
Intragruppo y off-shore***	0	0	2416	1575	0	0	1866	963	0	0	1126	992
Otros	232	28	667	1276	81	16	593	602	75	6	348	844
Total	260	260	7218	7218	97	97	5316	5316	81	81	4090	4090

* 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.