

Fecha de Publicación: 30 de abril de 2014

Fecha de Información: 28 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\$1584,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	395,5	421,2	271,5	243,5	10,7	13,0	139,0
15-35	251,1	363,7	247,1	139,0	25,7	21,1	91,0
36-60	68,5	73,5	25,0	0,0	3,1	23,1	45,4
61-90	66,8	5,1	0,0	0,0	4,7	66,4	0,4
91-180	86,4	98,7	45,0	0,0	28,1	60,9	25,6
>180	38,9	31,8	10,0	0,0	6,8	23,9	15,0
Total	907,2	994,0	598,6	382,5	79,0	208,3	316,4

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

*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	28 de abr. al 2 de mayo				5 al 9 de mayo				12 al 16 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	74	3091	3869	8	74	2750	2481	21	135	2001	2143
Intragruppo y off-shore***	0	0	1930	1157	0	0	1274	1041	0	0	1017	349
Otros	74	17	606	601	74	8	355	857	134	21	535	1061
Total	91	91	5627	5627	82	82	4379	4379	156	156	3553	3553

* 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.