

Fecha de Publicación: 5 de mayo de 2014

Fecha de Información: 30 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\$1292,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	223,1	94,6	74,0	197,0	20,6	26,1	0,0
15-35	180,9	666,5	349,5	30,0	217,0	50,9	100,0
36-60	8,1	11,2	0,0	0,0	10,8	7,7	0,4
61-90	4,1	72,4	1,7	0,0	67,8	1,2	2,9
91-180	72,1	37,9	0,0	0,0	27,9	62,1	10,0
>180	25,4	9,1	0,1	10,0	9,0	15,4	0,0
Total	513,6	891,7	425,3	237,0	353,1	163,3	113,3

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	4,0 %	1,8 %	2,3 %
15-35	3,4 %	3,7 %	3,0 %	3,6 %
36-60	3,4 %	3,9 %	2,9 %	3,5 %
61-90	3,6 %	3,9 %	3,1 %	3,9 %
91-180	3,7 %	4,0 %	3,5 %	3,6 %
>180	-	4,1 %	3,7 %	3,8 %
Total	3,5 %	3,7 %	2,5 %	3,3 %

*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**	18	73	3570	3951	8	75	2820	2595	22	137	2212	2400
Intragrupo y off-shore***	0	0	1953	1518	0	0	1345	1058	0	0	1082	461
Otros	73	18	607	661	75	8	377	890	137	22	638	1070
Total	91	91	6130	6130	84	84	4543	4543	159	159	3932	3932

* 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 intragrupo.