

Fecha de Publicación: 6 de mayo de 2014

Fecha de Información: 02 de mayo 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\$1073,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	232,5	353,2	221,0	78,1	42,2	64,4	90,0
15-35	345,4	147,3	57,0	234,2	36,3	57,2	54,0
36-60	13,8	22,9	3,1	3,6	14,8	5,2	5,0
61-90	10,9	85,3	55,0	0,0	19,4	0,0	10,9
91-180	0,0	11,6	1,0	0,0	10,6	0,0	0,0
>180	2,3	10,2	0,0	0,3	8,3	0,1	1,9
Total	604,9	630,4	337,1	316,2	131,5	126,9	161,8

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

*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	72	3570	3952	24	76	2979	2735	41	143	2247	2606
Intragruppo y off-shore***	0	0	1953	1518	0	1	1393	1117	0	0	1255	479
Otros	72	18	607	661	76	23	395	915	143	41	656	1072
Total	90	90	6131	6131	100	100	4767	4767	184	184	4157	4157

* 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.