

Fecha de Publicación: 7 de mayo de 2014

Fecha de Información: 05 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\$828,0 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	197,2	253,2	161,5	80,6	11,7	36,5	80,0
15-35	129,1	146,7	109,2	87,0	7,5	12,1	30,0
36-60	27,5	54,6	32,2	0,0	2,4	7,5	20,0
61-90	4,5	11,4	0,0	0,0	11,4	4,5	0,0
91-180	103,1	32,5	0,0	0,0	27,5	98,1	5,0
>180	1,9	1,4	0,0	0,0	1,4	1,9	0,0
Total	463,2	499,8	302,9	167,6	61,9	160,6	135,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,6 %	3,8 %	2,2 %	3,0 %
15-35	2,8 %	2,3 %	3,2 %	2,8 %
36-60	3,4 %	3,5 %	3,6 %	3,5 %
61-90	-	4,0 %	3,5 %	3,9 %
91-180	3,7 %	4,1 %	3,5 %	3,7 %
>180	-	4,2 %	3,4 %	3,7 %
Total	2,8 %	3,3 %	3,1 %	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	5 al 9 de mayo				12 al 16 de mayo				19 al 23 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	75	3075	2900	41	143	2340	2695	17	116	2581	3141
Intragruppo y off-shore***	0	1	1515	1158	0	0	1295	514	5	0	1942	825
Otros	75	27	397	930	143	41	664	1090	111	17	464	1021
Total	103	103	4988	4988	184	184	4300	4300	133	133	4986	4986

* 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.