

Fecha de Publicación: 8 de mayo de 2014

Fecha de Información: 06 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\$1774,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	245,9	280,9	174,5	141,5	16,4	14,4	90,0
15-35	472,4	386,5	270,5	332,0	9,0	33,4	107,0
36-60	117,6	97,3	19,5	21,7	62,8	80,9	15,0
61-90	1,5	12,2	0,0	0,0	10,9	0,2	1,3
91-180	168,7	143,9	80,3	20,0	23,6	108,7	40,0
>180	55,5	80,8	34,8	20,0	11,1	0,5	35,0
Total	1061,5	1001,7	579,6	535,2	133,8	238,0	288,3

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,5 %	2,8 %	2,9 %	3,0 %
15-35	3,5 %	3,3 %	3,1 %	3,2 %
36-60	0,0 %	3,7 %	3,1 %	3,1 %
61-90	3,3 %	4,3 %	0,1 %	4,1 %
91-180	3,6 %	3,7 %	3,5 %	3,6 %
>180	3,9 %	3,9 %	3,9 %	3,9 %
Total	3,4 %	3,3 %	3,2 %	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	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	74	3203	3067	43	143	2435	2747	17	117	2725	3214
Intragruppo y off-shore***	0	1	1634	1239	0	0	1320	575	5	0	1972	922
Otros	74	27	400	932	143	43	666	1099	112	17	468	1028
Total	101	101	5238	5238	187	187	4421	4421	134	134	5165	5165

* 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.