

Fecha de Publicación: 12 de mayo de 2014

Fecha de Información: 08 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\$1322,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	307,7	264,3	105,0	129,0	33,3	52,7	126,0
15-35	317,5	187,9	93,0	115,2	20,9	128,3	74,0
36-60	33,0	17,5	0,0	0,0	15,5	31,0	2,0
61-90	22,9	182,5	0,0	10,0	170,5	0,9	12,0
91-180	166,0	20,2	0,7	0,5	19,5	165,5	0,0
>180	0,0	16,9	2,2	0,0	14,6	0,0	0,0
Total	847,1	689,4	200,9	254,7	274,5	378,4	214,0

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

*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**	30	74	3363	3137	45	150	2555	2954	17	122	3147	3438
Intragruppo y off-shore***	0	1	1683	1344	0	0	1452	580	5	0	2008	1133
Otros	74	29	401	968	150	45	690	1163	117	17	478	1063
Total	104	104	5448	5448	194	194	4697	4697	139	139	5634	5634

* 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.