

Fecha de Publicación: 13 de mayo de 2014

Fecha de Información: 09 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\$983,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	340,9	378,0	260,0	217,8	46,0	51,2	72,0
15-35	151,2	98,8	69,0	124,1	12,8	10,1	17,0
36-60	10,0	20,1	9,9	0,0	10,2	10,0	0,0
61-90	2,9	11,2	0,0	1,2	11,2	1,7	0,0
91-180	12,1	15,9	0,0	1,8	15,9	10,3	0,0
>180	23,0	30,0	0,0	0,0	8,0	1,0	22,0
Total	540,2	554,0	338,9	344,9	104,1	84,3	111,0

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

*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	3131	45	150	2835	3128	17	121	3199	3642
Intragruppo y off-shore***	0	1	1683	1344	0	0	1551	762	5	0	2169	1168
Otros	74	29	396	968	150	45	706	1201	116	17	509	1067
Total	105	105	5443	5443	196	196	5092	5092	138	138	5877	5877

* 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.