

Fecha de Publicación: 14 de mayo de 2014

Fecha de Información: 12 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\$1287,0 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	280,1	118,2	47,0	199,5	11,2	20,6	60,0
15-35	386,8	286,2	225,6	135,0	7,5	198,8	53,0
36-60	27,8	46,3	30,0	0,0	6,3	17,8	10,0
61-90	9,0	66,7	0,0	0,0	66,7	9,0	0,0
91-180	124,4	21,0	0,0	5,6	21,0	118,8	0,0
>180	22,6	31,1	10,0	10,0	11,1	2,6	10,0
Total	850,6	569,4	312,6	350,1	123,8	367,5	133,0

* 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	1,3 %	3,6 %	2,8 %	2,6 %
15-35	2,6 %	3,7 %	3,0 %	3,2 %
36-60	3,2 %	3,5 %	3,0 %	3,3 %
61-90	-	3,9 %	3,1 %	3,8 %
91-180	-	4,0 %	3,4 %	3,5 %
>180	3,8 %	3,9 %	2,3 %	3,4 %
Total	2,1 %	3,7 %	3,0 %	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	12 al 16 de mayo				19 al 23 de mayo				26 al 30 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	48	151	2967	3207	18	130	3342	3677	13	105	2066	2395
Intragruppo y off-shore***	0	0	1588	852	5	0	2179	1278	0	0	1053	680
Otros	151	48	712	1208	125	18	509	1075	104	13	794	838
Total	199	199	5267	5267	148	148	6030	6030	118	118	3913	3913

* 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.