

Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2014

Fecha de Información: 14 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\$1447,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	371,8	287,5	110,0	162,0	18,5	50,8	159,0
15-35	421,5	420,2	310,5	242,1	15,9	85,6	93,8
36-60	9,5	19,4	9,6	0,0	6,1	5,9	3,7
61-90	4,6	33,2	0,0	0,0	33,2	4,6	0,0
91-180	27,9	17,1	10,2	20,0	6,8	7,9	0,0
>180	57,7	43,3	0,2	30,0	33,1	17,7	10,0
Total	893,0	820,6	440,6	454,1	113,6	172,4	266,5

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

*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	132	3372	3432	20	134	3481	3824	16	112	2239	2751
Intragruppo y off-shore***	0	0	1626	1076	5	0	2238	1295	0	0	1323	730
Otros	132	48	730	1219	129	20	548	1148	112	16	799	881
Total	180	180	5728	5728	153	153	6267	6267	127	127	4362	4362

* 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.