

Fecha de Publicación: 19 de mayo de 2014

Fecha de Información: 15 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\$1545,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	365,8	300,1	114,0	148,8	28,1	59,0	158,0
15-35	279,4	513,8	309,0	103,0	102,8	74,4	102,0
36-60	22,4	42,3	15,1	0,0	7,2	2,4	20,0
61-90	36,3	17,8	15,0	0,6	2,8	35,7	0,0
91-180	140,1	86,7	40,0	0,0	36,7	130,1	10,0
>180	29,6	1,7	0,6	0,6	1,1	29,0	0,0
Total	873,5	962,3	493,7	253,0	178,6	330,6	290,0

* 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	3,3 %	1,7 %	1,3 %	2,1 %
15-35	2,0 %	2,8 %	1,7 %	2,4 %
36-60	3,0 %	3,1 %	2,6 %	3,0 %
61-90	-	1,9 %	3,0 %	2,6 %
91-180	3,6 %	3,1 %	3,1 %	3,1 %
>180	-	4,2 %	3,6 %	3,6 %
Total	2,8 %	2,6 %	2,1 %	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	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**	49	144	3422	3427	20	128	3697	3990	18	111	2350	2945
Intragrupa y off-shore***	0	0	1626	1126	5	0	2292	1389	0	0	1393	735
Otros	144	49	725	1220	123	20	571	1180	111	18	856	919
Total	193	193	5773	5773	148	148	6559	6559	129	129	4599	4599

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.