

Fecha de Publicación: 22 de mayo de 2014

Fecha de Información: 20 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\$1523,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	163,0	116,3	56,0	108,6	29,3	23,4	31,0
15-35	552,9	549,4	354,4	321,0	1,9	38,9	193,0
36-60	2,8	1,3	0,3	0,0	0,9	2,8	0,0
61-90	35,0	23,1	0,4	0,0	22,7	35,0	0,0
91-180	148,6	161,1	56,2	0,0	24,9	68,6	80,0
>180	30,1	63,5	20,0	10,0	23,5	0,1	20,0
Total	932,5	914,6	487,3	439,6	103,3	168,9	324,0

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

*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	19 al 23 de mayo				26 al 30 de mayo				2 al 6 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	117	4144	4219	20	125	2598	3172	5	63	1508	1565
Intragruppo y off-shore***	0	0	2379	1706	0	0	1484	841	0	0	853	570
Otros	117	25	628	1225	125	20	871	939	63	5	299	525
Total	141	141	7151	7151	145	145	4953	4953	69	69	2660	2660

* 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 intragruppo.