

Fecha de Publicación: 23 de mayo de 2014

Fecha de Información: 21 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\$1474,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,2%.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	431,3	140,2	21,0	259,5	28,4	81,0	90,8
15-35	250,3	387,4	235,0	87,0	12,2	23,0	140,3
36-60	0,8	11,0	0,0	0,0	10,3	0,0	0,8
61-90	67,2	24,7	1,2	0,0	23,4	67,2	0,0
91-180	142,2	112,9	50,0	0,0	23,9	103,2	39,0
>180	40,4	147,5	71,5	0,4	65,5	29,5	10,5
Total	932,1	823,7	378,7	346,9	163,6	303,9	281,3

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

*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	112	4374	4262	20	128	2758	3240	5	65	1586	1650
Intragruppo y off-shore***	0	0	2379	1910	0	0	1505	897	0	0	873	570
Otros	112	25	647	1228	128	20	877	1003	65	5	302	541
Total	136	136	7400	7400	149	149	5140	5140	70	70	2761	2761

* 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.