

Fecha de Publicación: 26 de mayo de 2014

Fecha de Información: 22 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\$1514,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	297,2	181,7	80,0	177,8	16,7	34,4	85,0
15-35	315,6	280,5	231,8	175,0	6,3	98,3	42,3
36-60	10,1	6,2	0,0	0,0	6,2	10,1	0,0
61-90	150,8	67,5	52,0	0,0	15,5	150,8	0,0
91-180	193,6	133,4	70,0	0,0	33,4	163,6	30,0
>180	25,1	34,8	0,0	0,0	9,8	0,1	25,0
Total	992,4	704,2	433,8	352,8	88,1	457,3	182,3

* 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	2,5 %	2,8 %	2,3 %	2,5 %
15-35	1,4 %	2,7 %	1,5 %	1,9 %
36-60	-	4,5 %	2,8 %	3,4 %
61-90	-	2,2 %	3,0 %	2,8 %
91-180	3,1 %	2,6 %	3,1 %	2,9 %
>180	3,7 %	3,8 %	1,7 %	3,7 %
Total	2,5 %	2,7 %	2,4 %	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	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	116	4522	4326	21	131	2871	3309	5	65	1636	1727
Intragruppo y off-shore***	0	0	2379	1995	0	0	1545	957	0	0	935	603
Otros	116	25	648	1228	131	21	885	1036	65	5	302	542
Total	141	141	7549	7549	152	152	5301	5301	70	70	2872	2872

* 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.