

Fecha de Publicación: 27 de mayo de 2014

Fecha de Información: 23 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\$998,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	252,0	244,8	121,3	97,0	38,6	70,0	85,0
15-35	145,0	370,7	317,5	61,3	14,2	44,7	39,0
36-60	4,6	14,4	1,5	0,0	12,9	4,6	0,0
61-90	3,0	30,1	0,0	0,0	30,1	3,0	0,0
91-180	22,8	30,0	0,0	0,0	20,0	12,8	10,0
>180	2,0	13,0	0,0	0,0	13,0	2,0	0,0
Total	429,4	703,1	440,2	158,3	128,8	137,1	134,0

* 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	2,4 %	2,8 %	1,6 %	2,2 %
15-35	1,3 %	2,4 %	2,3 %	2,2 %
36-60	-	3,6 %	2,3 %	3,3 %
61-90	-	2,4 %	3,0 %	2,5 %
91-180	3,1 %	3,8 %	3,1 %	3,4 %
>180	-	4,4 %	3,5 %	4,2 %
Total	2,1 %	2,7 %	2,0 %	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	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**	24	113	4523	4327	24	124	3071	3514	5	65	1684	1768
Intragrupo y off-shore***	0	0	2379	1995	0	0	1637	1036	0	0	965	621
Otros	113	24	649	1229	124	24	923	1082	65	5	303	562
Total	137	137	7551	7551	148	148	5631	5631	70	70	2951	2951

* 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.