

Fecha de Publicación: 29 de mayo de 2014

Fecha de Información: 27 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\$1909,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	528,4	403,5	212,2	266,2	30,0	100,9	161,3
15-35	446,4	386,4	146,5	202,5	83,8	87,9	156,1
36-60	78,7	70,2	0,0	0,0	35,2	43,7	35,0
61-90	2,2	64,1	63,0	0,0	1,1	2,2	0,0
91-180	62,6	91,7	10,0	0,0	61,7	42,6	20,0
>180	90,5	88,3	50,0	0,0	7,0	59,2	31,3
Total	1208,8	1104,1	481,7	468,7	218,8	336,5	403,6

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

*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	26 al 30 de mayo				2 al 6 de junio				9 al 13 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	107	3591	3793	5	66	1742	1906	62	83	2225	2163
Intragruppo y off-shore***	0	0	1787	1305	0	0	1065	629	0	0	1188	972
Otros	107	24	938	1218	66	5	323	596	83	62	404	681
Total	131	131	6315	6315	71	71	3131	3131	145	145	3817	3817

* 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.