

Fecha de Publicación: 30 de mayo de 2014

Fecha de Información: 28 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\$1600,9 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	488,0	198,7	68,0	314,6	6,1	48,8	124,6
15-35	291,0	483,5	363,4	153,5	33,1	50,5	87,0
36-60	22,7	14,0	0,0	0,0	4,0	12,7	10,0
61-90	102,1	46,6	32,0	0,0	14,6	102,1	0,0
91-180	26,8	41,2	30,0	0,0	11,2	26,8	0,0
>180	101,1	36,6	0,0	10,0	6,6	61,1	30,0
Total	1031,7	820,7	493,4	478,1	75,7	302,0	251,6

* 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	2,1 %	3,6 %	1,3 %	1,8 %
15-35	1,7 %	2,5 %	1,9 %	2,2 %
36-60	2,5 %	3,0 %	2,6 %	2,6 %
61-90	-	3,2 %	2,5 %	2,7 %
91-180	-	2,6 %	3,0 %	2,8 %
>180	3,4 %	3,8 %	3,5 %	3,5 %
Total	2,2 %	2,7 %	1,9 %	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	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**	26	108	3930	3827	20	67	1787	1994	62	82	2374	2327
Intragruppo y off-shore***	0	0	1787	1612	0	0	1123	634	0	0	1225	974
Otros	108	26	943	1219	67	20	326	608	82	62	403	702
Total	133	133	6659	6659	88	88	3236	3236	145	145	4003	4003

* 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.