

Fecha de Publicación: 3 de junio de 2014

Fecha de Información: 29 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\$1173,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	199,7	158,4	70,0	84,3	2,4	29,3	86,0
15-35	262,6	499,2	348,5	95,0	59,7	76,6	91,0
36-60	64,6	47,0	28,1	20,0	3,9	29,6	15,0
61-90	8,3	56,3	47,0	0,0	9,0	8,1	0,2
91-180	26,0	42,2	10,8	1,0	11,3	4,8	20,2
>180	20,7	21,0	0,0	0,0	1,0	0,7	20,0
Total	581,9	824,1	504,4	200,4	87,3	149,1	232,4

* 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	2,3 %	2,5 %	2,0 %	2,2 %
15-35	2,3 %	2,8 %	2,1 %	2,5 %
36-60	2,8 %	2,8 %	2,5 %	2,6 %
61-90	3,1 %	3,1 %	2,3 %	3,0 %
91-180	3,1 %	3,4 %	3,1 %	3,2 %
>180	3,6 %	4,0 %	3,4 %	3,6 %
Total	2,5 %	2,8 %	2,1 %	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	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**	29	111	3955	3838	22	68	1917	2044	63	79	2413	2423
Intragrupa y off-shore***	0	0	1799	1632	0	0	1123	699	0	0	1283	974
Otros	111	29	941	1225	68	22	327	624	79	63	404	704
Total	140	140	6694	6694	90	90	3367	3367	142	142	4101	4101

* 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.