

Fecha de Publicación: 6 de junio de 2014

Fecha de Información: 04 de junio 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\$1269,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,3%.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	396,9	311,3	217,3	277,3	4,0	29,6	90,0
15-35	210,6	413,6	256,3	31,0	12,4	34,6	145,0
36-60	1,6	25,4	20,0	0,0	5,4	1,6	0,0
61-90	1,9	65,2	0,0	0,0	65,2	1,9	0,0
91-180	40,8	53,4	0,0	0,0	13,1	0,4	40,3
>180	20,3	23,9	0,0	0,0	3,6	0,0	20,3
Total	672,1	892,7	493,6	308,3	103,6	68,2	295,6

* 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 %	3,1 %	1,7 %	2,3 %
15-35	2,6 %	0,7 %	2,6 %	1,7 %
36-60	-	3,1 %	2,8 %	3,1 %
61-90	-	3,7 %	2,8 %	3,7 %
91-180	3,4 %	3,6 %	3,2 %	3,4 %
>180	3,8 %	4,5 %	-	3,9 %
Total	2,8 %	2,3 %	1,8 %	2,3 %

*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	2 al 6 de junio				9 al 13 de junio				16 al 20 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	65	2307	2451	93	90	2808	2890	17	108	2581	3108
Intragruppo y off-shore***	0	0	1367	925	0	1	1511	1148	0	0	1677	983
Otros	65	26	363	660	90	92	444	724	108	17	553	720
Total	91	91	4037	4037	183	183	4763	4763	125	125	4811	4811

* 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.