

Fecha de Publicación: 9 de junio de 2014

Fecha de Información: 05 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\$1185,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	257,4	268,6	81,0	30,0	15,6	55,4	172,0
15-35	230,9	475,0	311,5	31,0	21,5	57,9	142,0
36-60	93,5	89,9	0,0	0,0	17,9	21,5	72,0
61-90	80,7	10,4	0,0	0,0	10,4	80,7	0,0
91-180	6,7	27,6	0,9	0,0	26,7	6,7	0,0
>180	2,0	28,6	0,0	0,0	28,6	2,0	0,0
Total	671,2	900,1	393,4	61,0	120,7	224,2	386,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,7 %	4,0 %	3,2 %	3,1 %
15-35	3,3 %	3,6 %	3,0 %	3,4 %
36-60	3,3 %	3,6 %	2,8 %	3,3 %
61-90	-	3,9 %	3,2 %	3,3 %
91-180	-	4,0 %	3,4 %	3,9 %
>180	-	4,1 %	3,4 %	4,0 %
Total	3,0 %	3,7 %	3,1 %	3,3 %

*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	61	2319	2467	99	91	2898	2962	17	108	2769	3327
Intragruppo y off-shore***	0	0	1384	936	0	1	1516	1148	0	0	1736	1002
Otros	61	26	362	662	91	98	458	763	108	17	553	729
Total	87	87	4065	4065	190	190	4873	4873	125	125	5058	5058

* 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.