

Fecha de Publicación: 11 de junio de 2014

Fecha de Información: 09 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\$841,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	123,2	140,5	110,5	67,0	10,0	36,2	20,0
15-35	329,9	329,8	92,0	100,0	35,8	27,9	202,0
36-60	5,1	4,1	0,0	0,0	4,1	5,1	0,0
61-90	70,3	7,5	0,0	0,0	7,5	70,3	0,0
91-180	16,6	35,4	0,0	0,0	30,4	11,6	5,0
>180	0,0	5,6	0,0	0,0	5,6	0,0	0,0
Total	545,1	522,9	202,5	167,0	93,4	151,1	227,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,8 %	3,0 %	3,4 %	3,3 %
15-35	3,3 %	3,7 %	3,1 %	3,3 %
36-60	-	4,2 %	2,8 %	3,4 %
61-90	-	4,1 %	3,4 %	3,4 %
91-180	3,7 %	3,9 %	3,4 %	3,8 %
>180	-	4,4 %	-	4,4 %
Total	3,3 %	3,4 %	3,3 %	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	9 al 13 de junio				16 al 20 de junio				23 al 27 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	110	83	3037	3046	18	110	2926	3405	11	91	2129	2466
Intragrupo y off-shore***	0	1	1595	1266	0	0	1768	1049	0	0	1175	805
Otros	83	109	464	783	110	18	563	803	91	11	719	751
Total	193	193	5096	5096	128	128	5257	5257	102	102	4023	4023

* 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 intragrupo.