

Fecha de Publicación: 13 de junio de 2014

Fecha de Información: 11 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\$1524,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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 | 365,0 | 173,5 | 120,5 | 319,4 | 23,0 | 15,6 | 30,0 |
| 15-35 | 289,0 | 468,5 | 322,6 | 110,5 | 9,9 | 42,5 | 136,0 |
| 36-60 | 21,0 | 4,3 | 0,0 | 20,0 | 4,3 | 1,0 | 0,0 |
| 61-90 | 94,8 | 118,5 | 20,0 | 0,0 | 68,5 | 64,8 | 30,0 |
| 91-180 | 85,7 | 83,4 | 20,0 | 0,0 | 13,4 | 35,7 | 50,0 |
| >180 | 23,2 | 43,0 | 30,0 | 10,0 | 13,0 | 13,2 | 0,0 |
| Total | 878,8 | 891,3 | 513,1 | 459,9 | 132,2 | 172,9 | 246,0 |

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

*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 | 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** | 111 | 83 | 3313 | 3288 | 18 | 110 | 3117 | 3569 | 11 | 92 | 2294 | 2642 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 1 | 1790 | 1492 | 0 | 0 | 1853 | 1177 | 0 | 0 | 1266 | 882 |
| Otros | 83 | 110 | 473 | 795 | 110 | 18 | 586 | 810 | 92 | 11 | 730 | 767 |
| Total | 194 | 194 | 5576 | 5576 | 128 | 128 | 5556 | 5556 | 103 | 103 | 4290 | 4290 |

* 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.