

Fecha de Publicación: 16 de junio de 2014

Fecha de Información: 12 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\$881,3 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	88,4	149,7	80,4	34,4	39,3	24,0	30,0
15-35	94,2	202,5	151,5	29,5	11,0	24,7	40,0
36-60	0,1	17,4	0,0	0,0	17,4	0,1	0,0
61-90	128,8	74,1	0,0	0,0	49,1	103,8	25,0
91-180	181,4	83,4	1,4	0,8	18,0	116,5	64,1
>180	10,0	20,5	0,0	0,0	10,5	0,0	10,0
Total	502,9	547,6	233,3	64,7	145,2	269,1	169,1

* 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	3,6 %	3,7 %	1,8 %	3,1 %
15-35	3,0 %	3,8 %	3,2 %	3,5 %
36-60	-	3,8 %	3,4 %	3,8 %
61-90	3,7 %	4,0 %	3,5 %	3,7 %
91-180	3,7 %	4,2 %	3,6 %	3,7 %
>180	4,0 %	4,2 %	-	4,1 %
Total	3,5 %	3,8 %	3,2 %	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	3319	3334	19	118	3198	3618	11	92	2295	2698
Intragruppo y off-shore***	0	1	1835	1496	0	0	1858	1207	0	0	1305	882
Otros	83	110	474	797	118	19	600	831	92	11	748	767
Total	194	194	5628	5628	137	137	5656	5656	103	103	4347	4347

* 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.