

Fecha de Publicación: 17 de junio de 2014

Fecha de Información: 13 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\$771,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	199,3	175,3	108,0	128,0	27,3	31,3	40,0
15-35	135,5	217,3	143,3	18,0	11,1	54,5	63,0
36-60	14,5	13,9	0,0	0,0	12,7	13,3	1,2
61-90	0,4	23,6	0,0	0,0	23,6	0,4	0,0
91-180	54,3	32,5	14,0	0,0	18,5	54,3	0,0
>180	5,1	8,7	0,0	0,0	3,7	0,1	5,0
Total	409,0	471,2	265,3	146,0	96,8	153,8	109,2

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

*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	82	3322	3340	25	123	3341	3656	11	93	2345	2823		
Intragruppo y off-shore***	0	1	1835	1496	0	0	1900	1335	0	0	1371	882		
Otros	82	110	479	800	123	25	596	845	93	11	766	778		
Total	193	193	5636	5636	148	148	5836	5836	104	104	4482	4482		

* 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.