

Fecha de Publicación: 18 de junio de 2014

Fecha de Información: 16 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\$587,7 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	85,0	119,4	61,3	10,0	15,1	32,0	43,0
15-35	162,5	130,2	46,0	44,3	73,2	107,2	11,0
36-60	38,2	3,1	0,0	0,0	3,1	38,2	0,0
61-90	43,2	10,1	0,0	0,0	10,1	43,2	0,0
91-180	16,4	9,4	0,0	0,0	9,4	16,4	0,0
>180	20,4	3,8	0,0	0,0	3,8	20,4	0,0
Total	365,8	276,0	107,3	54,3	114,7	257,5	54,0

* 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	3,7 %	3,6 %	2,5 %	3,2 %
15-35	3,7 %	3,8 %	3,4 %	3,6 %
36-60	-	3,9 %	3,4 %	3,5 %
61-90	-	3,8 %	3,5 %	3,5 %
91-180	-	3,1 %	3,5 %	3,4 %
>180	-	4,1 %	3,9 %	3,9 %
Total	3,7 %	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	16 al 20 de junio				23 al 27 de junio				30 de jun. al 4 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	129	3396	3721	13	96	2374	2869	3	68	1065	1683
Intragruppo y off-shore***	0	0	1926	1335	0	0	1406	892	0	0	1057	290
Otros	129	25	592	857	96	13	778	796	68	3	231	381
Total	154	154	5914	5914	108	108	4557	4557	71	71	2354	2354

* 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.