

Fecha de Publicación: 20 de junio de 2014

Fecha de Información: 18 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\$1403,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	465,9	210,6	44,0	260,8	41,6	80,1	125,0
15-35	276,0	442,8	318,8	113,0	9,5	48,5	114,5
36-60	8,0	7,0	0,0	0,0	7,0	8,0	0,0
61-90	55,7	16,6	4,0	0,0	12,6	55,7	0,0
91-180	61,2	31,9	3,7	0,0	23,1	56,2	5,0
>180	53,3	34,1	6,4	0,0	12,8	38,3	15,0
Total	920,2	743,0	376,9	373,8	106,6	286,9	259,5

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

*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	127	3755	3882	15	93	2489	2963	3	68	1205	1745
Intragruppo y off-shore***	0	0	1981	1592	0	0	1452	939	0	0	1057	290
Otros	127	25	620	883	92	15	810	849	67	3	233	461
Total	152	152	6357	6357	107	107	4751	4751	71	71	2495	2495

* 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.