

Fecha de Publicación: 24 de junio de 2014

Fecha de Información: 19 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\$928,5 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	215,8	125,3	37,0	118,0	10,1	19,6	78,2
15-35	353,8	249,2	109,5	141,0	19,7	92,8	120,0
36-60	0,7	7,6	0,0	0,0	7,6	0,7	0,0
61-90	37,8	59,8	5,0	0,0	20,8	3,8	34,0
91-180	66,5	62,3	0,0	10,0	24,5	18,7	37,8
>180	7,4	12,2	0,0	7,0	12,2	0,4	0,0
Total	682,0	516,4	151,5	276,0	95,0	136,1	269,9

* 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 %	5,4 %	3,2 %	3,8 %
15-35	3,2 %	3,4 %	3,4 %	3,4 %
36-60	-	4,0 %	3,1 %	4,0 %
61-90	3,8 %	4,0 %	3,6 %	3,9 %
91-180	2,7 %	4,3 %	3,5 %	3,4 %
>180	-	4,1 %	4,0 %	4,1 %
Total	3,3 %	4,0 %	3,4 %	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	131	3839	3896	19	94	2544	2983	3	68	1277	1828
Intragruppo y off-shore***	0	0	2001	1676	0	0	1452	971	0	0	1074	292
Otros	131	25	615	883	94	19	818	860	67	3	234	465
Total	156	156	6455	6455	113	113	4814	4814	71	71	2585	2585

* 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.