

Fecha de Publicación: 26 de junio de 2014

Fecha de Información: 24 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\$901,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	206,2	145,6	52,6	82,5	1,0	31,6	92,0
15-35	290,9	288,2	171,5	139,2	15,8	50,7	101,0
36-60	12,6	10,2	1,9	0,0	7,4	11,6	1,0
61-90	79,5	13,3	0,0	0,0	13,3	79,5	0,0
91-180	4,3	22,0	0,0	0,0	22,0	4,3	0,0
>180	0,7	21,6	0,0	0,0	21,6	0,7	0,0
Total	594,1	500,9	225,9	221,8	81,0	178,3	194,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,9 %	2,1 %	2,0 %	2,0 %
15-35	3,6 %	3,5 %	3,1 %	3,4 %
36-60	3,8 %	4,0 %	3,5 %	3,7 %
61-90	-	4,1 %	3,5 %	3,6 %
91-180	-	4,2 %	3,6 %	4,1 %
>180	-	4,7 %	3,5 %	4,6 %
Total	2,8 %	3,6 %	2,9 %	3,1 %

*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	23 al 27 de junio				30 de jun. al 4 de julio				7 al 11 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	94	2970	3246	5	68	1379	1866	9	67	1732	2016
Intragruppo y off-shore***	0	0	1634	1280	0	0	1090	324	0	0	1087	662
Otros	94	24	805	883	67	5	236	514	67	9	376	517
Total	117	117	5409	5409	73	73	2704	2704	76	76	3195	3195

* 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.