

Fecha de Publicación: 27 de junio de 2014

Fecha de Información: 25 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\$880,9 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	142,1	14,8	0,0	75,9	4,8	56,2	10,0
15-35	349,8	203,2	106,0	221,5	17,2	48,3	80,0
36-60	2,8	7,3	0,0	0,0	7,3	2,8	0,0
61-90	52,3	65,6	0,0	0,0	65,6	52,3	0,0
91-180	16,0	78,3	0,0	0,0	77,4	15,1	1,0
>180	20,1	19,4	0,0	20,0	19,4	0,1	0,0
Total	583,1	388,7	106,0	317,4	191,7	174,8	91,0

* 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	2,5 %	3,3 %	2,3 %	2,3 %
15-35	2,4 %	2,5 %	2,5 %	2,5 %
36-60	-	3,5 %	2,6 %	3,2 %
61-90	-	4,5 %	3,3 %	4,0 %
91-180	3,6 %	5,2 %	3,2 %	4,9 %
>180	-	4,1 %	4,1 %	4,1 %
Total	2,4 %	3,9 %	2,7 %	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**	25	87	2995	3256	6	68	1426	1867	10	67	1822	2031		
Intragruppo y off-shore***	0	0	1634	1306	0	0	1090	333	0	0	1087	703		
Otros	87	25	815	882	67	6	237	552	67	10	381	556		
Total	112	112	5444	5444	74	74	2752	2752	77	77	3290	3290		

* 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.