

Fecha de Publicación: 5 de junio de 2014

Fecha de Información: 03 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\$988,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	128,1	279,7	199,0	13,2	14,7	48,9	66,0
15-35	197,0	304,7	220,0	103,0	37,2	46,5	47,5
36-60	15,6	41,3	0,0	0,0	41,3	15,6	0,0
61-90	64,1	13,1	0,0	0,0	13,1	64,1	0,0
91-180	28,0	15,5	0,7	0,0	14,1	27,3	0,7
>180	12,7	2,8	0,0	0,0	2,4	12,3	0,4
Total	445,5	657,1	419,7	116,2	122,8	214,7	114,6

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

*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

Sectores	2 al 6 de junio				9 al 13 de junio				16 al 20 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	67	2150	2374	88	90	2595	2663	17	107	2558	3079
Intragrupo y off-shore***	0	0	1312	789	0	1	1356	1017	0	0	1650	973
Otros	67	26	361	660	90	86	442	713	107	17	551	708
Total	93	93	3823	3823	177	177	4393	4393	125	125	4759	4759

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.