

Fecha de Publicación: 10 de junio de 2014

Fecha de Información: 06 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\$888,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	183,8	27,1	5,0	98,0	6,1	69,8	16,0
15-35	262,8	272,6	230,1	126,0	15,4	109,7	27,1
36-60	4,4	24,5	0,0	0,0	24,5	4,4	0,0
61-90	19,6	29,6	0,0	0,5	14,4	3,9	15,3
91-180	17,6	72,1	0,0	10,0	67,1	2,6	5,0
>180	23,7	33,9	0,1	1,0	13,8	2,7	20,0
Total	511,9	459,9	235,2	235,5	141,3	193,1	83,4

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

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**	27	63	2319	2471	109	90	2988	2961	17	110	2854	3345
Intragrupo y off-shore***	0	0	1388	936	0	1	1516	1222	0	0	1737	1026
Otros	63	27	362	662	90	107	458	779	110	17	554	774
Total	90	90	4069	4069	199	199	4962	4962	128	128	5145	5145

* 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.