

Fecha de Publicación: 2 de julio de 2014

Fecha de Información: 27 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\$1358,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,3%.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	213,6	142,9	86,0	99,8	11,9	68,8	45,0
15-35	229,5	632,3	434,1	73,3	130,7	88,7	67,5
36-60	5,8	65,1	0,0	0,0	65,1	5,8	0,0
61-90	68,6	38,8	0,0	20,0	18,8	28,6	20,0
91-180	0,2	42,0	0,0	0,0	42,0	0,2	0,0
>180	41,9	10,3	0,0	40,0	10,3	1,9	0,0
Total	559,5	931,5	520,1	233,1	278,9	193,9	132,5

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

*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	86	3081	3302	7	68	1599	1986	12	67	1896	2086
Intragruppo y off-shore***	0	0	1663	1368	0	0	1154	426	0	0	1123	711
Otros	86	25	817	891	68	7	251	592	67	12	392	614
Total	111	111	5562	5562	75	75	3004	3004	79	79	3411	3411

* 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.