

Fecha de Publicación: 3 de julio de 2014

Fecha de Información: 01 de julio 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\$2095,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	541,7	255,1	172,5	477,7	82,6	64,0	0,0
15-35	419,9	570,6	373,0	270,0	92,6	44,9	105,0
36-60	11,5	22,1	0,0	0,0	22,1	11,5	0,0
61-90	85,5	29,7	0,0	0,0	29,7	85,5	0,0
91-180	0,0	208,6	91,3	0,0	117,2	0,0	0,0
>180	50,5	15,1	0,0	40,0	5,1	0,5	10,0
Total	1109,2	1101,2	636,8	787,7	349,4	206,5	115,0

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

*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	30 de jun. al 4 de julio				7 al 11 de julio				14 al 18 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	58	1930	2039	28	71	2056	2247	12	145	1437	1763
Intragruppo y off-shore***	0	0	1192	741	0	1	1223	834	0	0	916	482
Otros	58	7	267	608	70	26	454	651	145	12	524	632
Total	65	65	3388	3388	98	98	3732	3732	157	157	2877	2877

* 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.