

Fecha de Publicación: 4 de julio de 2014

Fecha de Información: 02 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\$1705,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	205,9	392,9	278,0	76,0	21,9	36,9	93,0
15-35	367,1	628,7	388,5	123,0	47,3	51,1	193,0
36-60	5,2	30,0	10,0	0,0	20,0	5,2	0,0
61-90	46,0	31,2	10,0	0,0	11,2	36,0	10,0
91-180	83,2	151,0	50,0	0,0	26,0	8,2	75,0
>180	120,4	45,7	0,0	20,0	14,9	69,6	30,8
Total	827,7	1279,5	736,5	219,0	141,3	206,9	401,8

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

*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

Sectores	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	59	2033	2139	28	73	2140	2344	13	145	1455	1977
Intragrupa y off-shore***	0	0	1219	771	0	1	1289	880	0	0	1123	482
Otros	59	7	267	608	73	26	464	669	145	13	531	651
Total	66	66	3519	3519	101	101	3893	3893	158	158	3110	3110

* 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 intragrupo.