

Fecha de Publicación: 7 de julio de 2014

Fecha de Información: 03 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\$1988,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	398,1	388,3	151,0	204,0	77,3	34,1	160,0
15-35	479,3	670,3	359,8	146,0	60,5	83,3	250,0
36-60	10,8	79,6	32,0	0,0	47,6	10,8	0,0
61-90	151,2	34,7	0,0	0,0	34,7	151,2	0,0
91-180	13,3	62,4	0,0	0,0	62,4	13,3	0,0
>180	50,0	75,0	36,8	35,0	23,3	0,0	15,0
Total	1102,7	1310,4	579,5	385,0	305,9	292,7	425,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,8 %	3,0 %	2,6 %	2,8 %
15-35	2,2 %	2,5 %	2,3 %	2,4 %
36-60	-	3,3 %	2,6 %	3,2 %
61-90	-	3,8 %	2,9 %	3,1 %
91-180	-	3,9 %	3,4 %	3,8 %
>180	4,0 %	3,8 %	3,6 %	3,8 %
Total	2,5 %	3,0 %	2,6 %	2,8 %

*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	2074	2140	28	73	2421	2666	13	147	1564	2047
Intragrupo y off-shore***	0	0	1219	771	0	1	1437	1036	0	0	1133	530
Otros	57	7	268	649	73	26	533	689	147	13	536	656
Total	65	65	3560	3560	101	101	4391	4391	160	160	3233	3233

* 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.