

Fecha de Publicación: 9 de julio de 2014

Fecha de Información: 07 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\$1133,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	255,0	265,4	109,5	40,5	13,9	72,5	142,0
15-35	288,9	430,1	251,1	52,6	28,0	85,3	151,0
36-60	51,5	53,8	1,2	0,0	14,3	13,2	38,3
61-90	3,9	12,9	0,0	0,0	12,9	3,9	0,0
91-180	8,8	43,2	1,8	0,0	41,4	8,8	0,0
>180	15,0	51,1	30,0	0,0	6,1	0,0	15,0
Total	623,2	856,5	393,6	93,1	116,6	183,8	346,3

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

*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	7 al 11 de julio				14 al 18 de julio				21 al 25 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	81	2521	2796	13	147	1721	2174	12	179	1719	1928
Intragruppo y off-shore***	0	1	1541	1076	0	0	1138	530	0	0	740	365
Otros	81	28	537	727	147	13	538	693	179	12	459	624
Total	110	110	4599	4599	160	160	3397	3397	190	190	2917	2917

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.