

Fecha de Publicación: 10 de julio de 2014

Fecha de Información: 08 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\$879,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	149,8	258,9	146,5	16,5	9,4	30,3	103,0
15-35	254,9	137,6	75,0	158,5	18,6	52,4	44,0
36-60	0,5	1,1	0,0	0,0	1,1	0,5	0,0
61-90	2,9	2,9	0,0	0,0	2,9	2,9	0,0
91-180	35,0	74,6	35,0	10,0	24,6	10,0	15,0
>180	118,9	54,6	0,0	65,5	4,6	3,4	50,0
Total	562,0	529,7	256,5	250,5	61,2	99,5	212,0

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

*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	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	84	2561	2945	14	146	1824	2252	12	182	1751	1964
Intragrupa y off-shore***	0	1	1654	1076	0	0	1142	544	0	0	770	388
Otros	83	27	541	734	146	14	542	712	182	12	465	635
Total	112	112	4755	4755	160	160	3508	3508	193	193	2986	2986

* 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.