

Fecha de Publicación: 11 de julio de 2014

Fecha de Información: 09 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\$1142,7 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	199,4	125,6	2,0	92,0	56,1	39,9	67,5
15-35	313,5	505,5	301,0	30,0	30,4	109,5	174,0
36-60	9,0	16,9	0,0	0,0	16,9	9,0	0,0
61-90	80,0	19,4	0,0	30,0	19,4	50,0	0,0
91-180	28,3	22,5	0,0	0,0	22,5	28,3	0,0
>180	40,5	33,5	0,1	30,0	23,4	0,5	10,0
Total	670,7	723,5	303,1	182,0	168,8	237,2	251,5

* 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	3,6 %	4,0 %	3,9 %	3,9 %
15-35	3,6 %	3,8 %	3,5 %	3,7 %
36-60	-	4,3 %	3,7 %	4,1 %
61-90	-	4,3 %	3,3 %	3,5 %
91-180	-	4,3 %	3,6 %	3,9 %
>180	4,0 %	5,1 %	4,0 %	4,5 %
Total	3,6 %	4,0 %	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	76	2664	2968	16	146	1865	2312	12	181	1829	2033
Intragrupa y off-shore***	0	1	1656	1164	0	0	1142	544	0	0	770	392
Otros	76	28	550	738	146	16	593	744	181	12	467	641
Total	106	106	4870	4870	162	162	3600	3600	193	193	3066	3066

* 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.