

Fecha de Publicación: 14 de julio de 2014

Fecha de Información: 10 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\$1257,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.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	208,1	203,7	79,5	74,0	7,2	17,1	117,0
15-35	285,8	433,1	304,0	85,4	50,1	121,4	79,0
36-60	4,2	30,6	0,0	0,0	30,6	4,2	0,0
61-90	43,5	28,2	0,0	0,0	28,2	43,5	0,0
91-180	5,0	53,4	0,0	0,0	53,4	5,0	0,0
>180	30,6	137,4	0,0	0,0	127,4	20,6	10,0
Total	577,1	886,5	383,5	159,4	297,0	211,7	206,0

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

*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	77	2775	2953	16	146	1933	2393	12	181	1867	2085
Intragrupa y off-shore***	0	1	1681	1219	0	0	1182	563	0	0	785	392
Otros	77	28	456	739	146	16	597	756	181	12	469	644
Total	106	106	4911	4911	162	162	3712	3712	193	193	3121	3121

* 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 intragrupo.