

Fecha de Publicación: 15 de julio de 2014

Fecha de Información: 11 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\$976,2 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	193,1	256,8	234,5	161,5	5,3	14,6	17,0
15-35	281,9	304,0	212,0	91,0	11,7	110,6	80,3
36-60	0,2	3,9	0,0	0,0	3,9	0,2	0,0
61-90	1,0	4,0	0,0	0,0	4,0	1,0	0,0
91-180	0,0	23,3	10,0	0,0	13,3	0,0	0,0
>180	0,0	5,3	0,0	0,0	5,3	0,0	0,0
Total	476,3	597,2	456,5	252,5	43,4	126,5	97,3

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,3 %	3,6 %	3,6 %	3,7 %
15-35	3,9 %	3,7 %	3,5 %	3,7 %
36-60	-	4,4 %	2,8 %	4,3 %
61-90	-	4,3 %	3,5 %	4,2 %
91-180	-	4,4 %	3,4 %	4,4 %
>180	-	4,2 %	-	4,2 %
Total	3,9 %	3,7 %	3,6 %	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

Sectores	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	2775	2953	16	143	2118	2604	11	181	1875	2134
Intragrupa y off-shore***	0	1	1681	1219	0	0	1367	724	0	0	834	392
Otros	76	28	456	739	143	16	605	763	181	11	469	652
Total	106	106	4911	4911	160	160	4091	4091	192	192	3178	3178

* 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.