

Fecha de Publicación: 18 de julio de 2014

Fecha de Información: 16 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\$1406,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	387,9	414,2	245,2	243,0	64,0	39,9	105,0
15-35	243,6	352,8	271,1	113,5	11,1	59,5	70,6
36-60	2,7	30,3	0,0	0,0	30,3	2,7	0,0
61-90	0,2	72,8	0,0	0,0	72,8	0,2	0,0
91-180	11,1	30,5	0,0	0,0	30,5	11,1	0,0
>180	30,8	25,2	0,1	0,0	5,1	10,8	20,0
Total	676,4	925,9	516,4	356,5	213,9	124,3	195,6

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

*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	14 al 18 de julio				21 al 25 de julio				28 de jul. al 1 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	142	2462	2748	14	186	2201	2714	46	120	2173	3144
Intragrupa y off-shore***	0	0	1462	983	0	0	1138	445	0	0	1964	887
Otros	141	16	595	787	186	14	534	714	120	46	561	667
Total	158	158	4518	4518	200	200	3873	3873	166	166	4697	4697

* 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.