

Fecha de Publicación: 21 de julio de 2014

Fecha de Información: 17 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\$969,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	210,7	223,3	114,0	85,0	27,3	43,7	82,0
15-35	173,1	208,5	135,6	81,0	63,1	82,1	9,9
36-60	13,4	1,6	0,0	0,0	1,6	13,4	0,0
61-90	6,0	62,9	0,0	0,0	62,9	6,0	0,0
91-180	28,4	6,4	0,0	10,0	6,4	18,4	0,0
>180	66,2	96,3	57,0	30,0	4,3	1,2	35,0
Total	497,9	599,0	306,6	206,0	165,5	164,9	126,9

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

*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**	18	144	2492	2749	17	184	2325	2813	46	120	2237	3267
Intragrupa y off-shore***	0	0	1462	1012	0	0	1172	494	0	0	2044	894
Otros	144	18	596	788	184	17	544	734	120	46	577	697
Total	162	162	4550	4550	201	201	4041	4041	166	166	4857	4857

* 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.