

Fecha de Publicación: 22 de julio de 2014

Fecha de Información: 18 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\$863,8 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	227,2	148,2	89,3	130,8	6,9	44,4	52,0
15-35	358,0	294,0	128,3	173,5	10,2	29,0	155,5
36-60	5,8	1,7	0,0	0,0	1,7	5,8	0,0
61-90	1,1	4,7	0,0	0,0	4,7	1,1	0,0
91-180	1,6	9,6	0,9	0,0	7,4	0,3	1,3
>180	0,0	20,8	0,0	0,0	20,8	0,0	0,0
Total	593,7	478,9	218,5	304,3	51,6	80,6	208,8

* 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	3,9 %	3,9 %	3,6 %	3,7 %
15-35	2,9 %	4,0 %	3,5 %	3,4 %
36-60	-	4,9 %	3,5 %	3,8 %
61-90	-	5,2 %	3,6 %	4,9 %
91-180	4,0 %	4,4 %	3,4 %	4,3 %
>180	-	4,2 %	-	4,2 %
Total	3,2 %	4,0 %	3,6 %	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**	18	144	2492	2750	18	185	2467	2942	46	125	2321	3282
Intragrupa y off-shore***	0	0	1462	1012	0	0	1247	578	0	0	2058	940
Otros	144	18	598	788	185	18	546	740	125	46	578	735
Total	161	161	4551	4551	203	203	4260	4260	171	171	4957	4957

* 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.