

Fecha de Publicación: 23 de julio de 2014

Fecha de Información: 21 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\$1572,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	310,9	217,6	52,0	159,0	52,9	39,2	112,7
15-35	440,0	430,2	288,5	286,5	21,7	33,5	120,0
36-60	39,5	43,4	1,2	0,0	12,2	9,5	30,0
61-90	109,0	30,8	0,0	0,0	15,8	94,0	15,0
91-180	42,7	155,9	52,8	0,0	73,1	12,7	30,0
>180	2,5	57,7	0,0	0,0	57,7	2,5	0,0
Total	944,7	935,6	394,5	445,5	233,4	191,5	307,7

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

*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	21 al 25 de julio				28 de jul. al 1 de agosto				4 al 8 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	185	2700	3088	46	125	2398	3354	7	81	2248	2520
Intragrupa y off-shore***	0	0	1285	712	0	0	2072	965	0	0	1480	497
Otros	185	18	559	744	125	46	618	769	81	7	313	1025
Total	203	203	4544	4544	171	171	5088	5088	88	88	4041	4041

* 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.