

Fecha de Publicación: 24 de julio de 2014

Fecha de Información: 22 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\$1410,3 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	389,6	433,6	140,0	182,0	125,6	39,6	168,0
15-35	371,5	207,8	144,9	258,0	29,9	80,5	33,0
36-60	18,7	19,4	0,0	0,0	19,4	18,7	0,0
61-90	11,8	29,4	0,0	0,0	29,4	11,8	0,0
91-180	15,0	66,8	3,4	15,0	63,4	0,0	0,0
>180	15,2	42,4	9,0	0,0	23,4	5,2	10,0
Total	821,9	799,4	297,3	455,0	291,1	155,9	211,0

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

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	191	2804	3128	46	127	2627	3676	7	82	2323	2599
Intragrupa y off-shore***	0	0	1297	784	0	0	2200	1075	0	0	1480	515
Otros	191	18	557	745	127	46	710	787	82	7	355	1045
Total	209	209	4657	4657	173	173	5537	5537	89	89	4159	4159

* 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.