

Fecha de Publicación: 28 de julio de 2014

Fecha de Información: 24 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\$1097,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	205,6	168,8	110,5	100,0	8,3	55,6	50,0
15-35	313,1	391,2	220,5	111,0	40,7	72,1	130,0
36-60	31,6	6,5	0,0	23,5	4,7	6,3	1,8
61-90	6,9	43,0	37,5	0,0	5,5	6,9	0,0
91-180	45,4	86,4	20,0	0,0	21,0	0,0	45,4
>180	6,2	20,0	10,0	0,0	10,0	6,2	0,0
Total	608,8	715,9	398,6	234,5	90,1	147,1	227,2

* 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	3,8 %	3,9 %	3,6 %	3,7 %
15-35	3,9 %	4,1 %	2,9 %	3,7 %
36-60	3,9 %	4,9 %	3,5 %	4,1 %
61-90	-	4,2 %	3,5 %	3,8 %
91-180	2,9 %	3,5 %	3,2 %	3,2 %
>180	-	4,2 %	3,9 %	4,1 %
Total	3,7 %	4,0 %	3,3 %	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	195	2874	3166	50	127	2776	3876	32	83	2455	2731
Intragrupo y off-shore***	0	0	1325	844	0	0	2308	1160	0	0	1532	558
Otros	195	18	554	744	127	50	770	818	83	32	386	1084
Total	213	213	4754	4754	176	176	5854	5854	114	114	4373	4373

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.