

Fecha de Publicación: 30 de julio de 2014

Fecha de Información: 28 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\$851,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	179,1	67,8	42,0	136,5	9,3	26,1	16,5
15-35	175,9	260,6	172,5	112,1	74,1	49,9	14,0
36-60	23,1	46,8	40,0	0,0	6,0	22,4	0,8
61-90	0,4	9,9	0,0	0,0	9,9	0,4	0,0
91-180	15,4	23,2	0,0	0,0	22,1	14,3	1,1
>180	31,3	50,7	46,5	31,2	4,2	0,1	0,0
Total	425,2	458,9	301,0	279,8	125,6	113,1	32,4

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,6 %	4,1 %	2,1 %	2,4 %
15-35	3,9 %	4,1 %	4,0 %	4,0 %
36-60	4,0 %	4,0 %	3,8 %	3,9 %
61-90	-	4,3 %	3,5 %	4,3 %
91-180	3,9 %	4,4 %	3,6 %	4,1 %
>180	-	4,2 %	4,3 %	4,3 %
Total	2,2 %	4,1 %	3,2 %	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	28 de jul. al 1 de agosto				4 al 8 de agosto				11 al 15 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	133	3157	3996	32	78	2495	2913	10	100	2549	2567
Intragruppo y off-shore***	0	0	2385	1456	0	0	1700	573	0	0	1450	495
Otros	133	52	777	867	78	32	390	1099	100	10	404	1341
Total	185	185	6319	6319	110	110	4585	4585	110	110	4403	4403

* 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 intragruppo.