

Fecha de Publicación: 1 de agosto de 2014

Fecha de Información: 30 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\$1767,7 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	376,9	112,2	32,3	299,0	65,0	62,9	15,0
15-35	210,1	728,9	644,8	74,3	24,2	76,0	59,9
36-60	81,6	3,4	0,2	0,0	3,2	81,6	0,0
61-90	53,5	116,5	0,0	20,0	106,5	23,5	10,0
91-180	85,0	56,5	0,0	0,0	41,5	70,0	15,0
>180	26,0	17,2	15,0	0,0	2,2	26,0	0,0
Total	833,0	1034,6	692,2	393,3	242,5	339,8	99,9

* 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	3,3 %	4,2 %	2,1 %	2,6 %
15-35	4,0 %	4,0 %	3,7 %	4,0 %
36-60	-	4,4 %	3,7 %	3,8 %
61-90	3,8 %	4,3 %	3,9 %	4,1 %
91-180	4,0 %	4,2 %	3,9 %	4,0 %
>180	-	4,1 %	4,0 %	4,1 %
Total	3,9 %	4,1 %	2,9 %	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**	32	122	3627	4192	44	77	2692	3176	22	106	2645	2613
Intragruppo y off-shore***	0	0	2498	1834	0	0	1736	573	0	0	1487	549
Otros	122	32	800	898	77	44	482	1161	106	22	413	1383
Total	155	155	6924	6924	121	121	4910	4910	129	129	4545	4545

* 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.