

Fecha de Publicación: 16 de julio de 2014

Fecha de Información: 14 de julio de 2014¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1012,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	250,2	287,2	106,0	31,0	6,0	44,0	175,3
15-35	251,9	279,5	176,5	78,0	15,0	85,9	88,0
36-60	72,2	27,5	20,0	0,0	7,5	72,2	0,0
61-90	2,6	10,5	0,0	0,0	10,5	2,6	0,0
91-180	27,5	43,5	0,0	20,0	43,5	7,5	0,0
>180	20,2	13,2	0,0	10,0	3,2	0,2	10,0
Total	624,5	661,3	302,5	139,0	85,6	212,3	273,3

* 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 %	4,0 %	2,8 %	3,6 %
15-35	3,9 %	4,0 %	3,7 %	3,8 %
36-60	-	4,0 %	3,5 %	3,7 %
61-90	-	4,1 %	3,7 %	4,0 %
91-180	-	4,2 %	3,9 %	4,1 %
>180	4,2 %	4,4 %	4,1 %	4,2 %
Total	3,8 %	4,0 %	3,5 %	3,8 %

*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

Sectores	14 al 18 de julio				21 al 25 de julio				28 de jul. al 1 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	140	2185	2636	12	182	2006	2334	46	119	1992	2908
Intragrupo y off-shore***	0	0	1380	742	0	0	927	395	0	0	1806	842
Otros	140	16	585	772	182	12	475	679	119	46	552	600
Total	156	156	4151	4151	194	194	3408	3408	165	165	4350	4350

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.