

Fecha de Publicación: 31 de julio de 2014

Fecha de Información: 29 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\$1342,0 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	311,6	369,8	141,0	83,0	48,8	48,6	180,0
15-35	397,9	317,4	239,0	200,0	40,4	159,9	38,0
36-60	34,9	2,4	0,0	0,0	2,4	34,9	0,0
61-90	0,5	13,0	0,0	0,0	13,0	0,5	0,0
91-180	47,3	45,1	0,0	20,0	35,1	17,3	10,0
>180	25,3	4,9	0,0	15,0	4,9	10,3	0,0
Total	817,3	752,6	380,0	318,0	144,6	271,3	228,0

* 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	
3-14	3,0 %	4,1 %	2,5 %	3,3 %
15-35	3,8 %	3,4 %	3,8 %	3,7 %
36-60	-	5,3 %	3,7 %	3,8 %
61-90	-	33,1 %	3,5 %	32,1 %
91-180	4,0 %	4,2 %	3,3 %	3,8 %
>180	-	5,2 %	4,0 %	4,4 %
Total	3,1 %	4,8 %	3,4 %	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	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	123	3306	4149	42	78	2658	3126	20	104	2614	2595
Intragrupo y off-shore***	0	0	2475	1535	0	0	1736	573	0	0	1477	549
Otros	123	32	790	887	78	42	437	1132	104	20	404	1352
Total	154	154	6570	6570	119	119	4830	4830	124	124	4495	4495

* 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.