

Fecha de Publicación: 6 de agosto de 2014

Fecha de Información: 04 de agosto 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\$1253,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	374,3	386,2	216,0	201,0	20,2	23,3	150,0
15-35	256,0	256,7	159,0	124,0	15,7	50,0	82,0
36-60	125,9	21,3	0,0	0,0	1,3	105,9	20,0
61-90	1,0	5,6	0,0	0,0	5,6	1,0	0,0
91-180	38,1	53,9	0,0	10,0	25,9	0,1	28,0
>180	0,2	14,0	0,0	0,0	14,0	0,2	0,0
Total	795,6	737,7	375,0	335,0	82,7	180,6	280,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,9 %	3,8 %	3,3 %	3,6 %
15-35	4,0 %	4,1 %	3,8 %	4,0 %
36-60	4,0 %	4,4 %	3,7 %	3,8 %
61-90	-	4,3 %	3,5 %	4,2 %
91-180	4,0 %	4,2 %	4,0 %	4,1 %
>180	-	4,2 %	3,7 %	4,2 %
Total	3,9 %	4,0 %	3,6 %	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**

Sector	4 al 8 de agosto				11 al 15 de agosto				18 al 22 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	47	81	3243	3664	22	114	2871	3021	12	93	2163	1728
Intragruppo y off-shore***	0	1	1890	835	0	0	1774	622	0	0	1002	864
Otros	81	45	554	1188	114	22	429	1431	93	12	347	921
Total	128	128	5686	5686	136	136	5074	5074	105	105	3513	3513

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