

Fecha de Publicación: 8 de agosto de 2014

Fecha de Información: 05 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\$2173,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.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	567,5	452,6	234,5	298,5	152,6	203,5	65,5
15-35	401,1	582,7	380,0	69,2	35,7	164,9	167,0
36-60	95,1	19,0	0,0	0,0	19,0	95,1	0,0
61-90	15,8	158,2	40,0	0,0	108,2	5,8	10,0
91-180	34,8	31,3	0,0	0,0	18,3	21,8	13,0
>180	65,9	28,3	0,0	31,2	5,3	11,7	23,0
Total	1180,3	1272,1	654,5	398,9	339,1	502,9	278,5

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

*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	87	3587	3794	22	116	3035	3268	12	97	2258	1800
Intragruppo y off-shore***	0	1	1952	1110	0	0	1937	645	0	0	1011	864
Otros	87	45	556	1191	116	22	513	1572	97	12	410	1016
Total	133	133	6095	6095	138	138	5484	5484	109	109	3679	3679

* 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.