

Fecha de Publicación: 12 de agosto de 2014

Fecha de Información: 08 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\$801,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	204,1	114,7	111,2	60,1	3,5	143,9	0,0
15-35	179,3	223,5	187,0	128,0	10,5	25,3	26,0
36-60	16,9	21,7	12,7	0,0	9,0	16,9	0,0
61-90	1,3	4,9	0,0	0,0	4,9	1,3	0,0
91-180	15,3	46,3	15,0	0,2	16,3	0,1	15,0
>180	10,1	4,4	0,0	10,0	4,4	0,1	0,0
Total	427,0	415,5	325,9	198,3	48,6	187,7	41,0

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

*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	82	3715	3855	24	130	3240	3555	12	99	2428	1984
Intragrupa y off-shore***	0	1	1981	1211	5	0	2124	779	0	0	1156	884
Otros	82	45	573	1203	124	24	583	1613	99	12	450	1166
Total	129	129	6270	6270	154	154	5947	5947	111	111	4034	4034

* 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 intragrupo.