

Fecha de Publicación: 15 de agosto de 2014

Fecha de Información: 13 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\$1466,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	464,4	320,2	279,5	417,5	28,7	34,9	12,0
15-35	195,1	314,9	287,5	93,0	21,4	96,1	6,0
36-60	40,4	33,7	0,0	0,0	33,7	40,4	0,0
61-90	69,4	7,3	0,0	0,0	7,3	69,4	0,0
91-180	11,5	22,4	10,0	0,2	12,4	11,3	0,0
>180	0,1	5,2	2,8	0,1	2,4	0,0	0,0
Total	781,0	703,7	579,8	510,8	105,9	252,2	18,0

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

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	11 al 15 de agosto				18 al 22 de agosto				25 al 29 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	124	3788	3772	12	111	2691	2592	11	132	2388	3189
Intragruppo y off-shore***	5	0	2229	1251	0	0	1552	965	0	0	1773	553
Otros	119	24	630	1624	111	12	524	1210	132	11	835	1254
Total	148	148	6647	6647	124	124	4767	4767	142	142	4996	4996

* 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.