

Fecha de Publicación: 21 de agosto de 2014

Fecha de Información: 19 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\$2138,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	423,8	265,8	171,5	265,0	59,3	123,8	35,0
15-35	428,5	850,7	670,0	68,0	75,4	255,2	105,3
36-60	37,9	31,8	0,0	0,0	31,8	37,9	0,0
61-90	7,6	16,4	0,0	0,0	16,4	7,6	0,0
91-180	38,7	109,8	102,0	0,0	7,3	38,2	0,5
>180	64,4	14,0	0,0	50,0	4,0	4,4	10,0
Total	1000,9	1288,4	943,5	383,0	194,1	467,1	150,8

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

*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	18 al 22 de agosto				25 al 29 de agosto				1 al 5 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	111	3201	2966	12	137	2623	3296	6	77	1645	1905
Intragrupa y off-shore***	0	0	1806	1249	0	0	1849	633	0	0	1127	441
Otros	111	13	546	1338	137	12	866	1409	77	6	249	676
Total	124	124	5553	5553	149	149	5338	5338	84	84	3022	3022

* 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.