

Fecha de Publicación: 22 de agosto de 2014

Fecha de Información: 20 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\$2157,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	410,4	254,5	131,0	199,8	45,5	132,6	78,0
15-35	370,7	963,1	763,8	136,2	30,8	66,0	168,5
36-60	27,2	24,0	15,8	0,0	8,2	27,2	0,0
61-90	85,6	6,9	0,0	0,0	6,9	85,6	0,0
91-180	134,7	39,4	20,0	81,0	18,4	52,7	1,0
>180	84,1	54,4	0,0	0,0	4,4	34,1	50,0
Total	1112,7	1342,2	930,6	417,0	114,1	398,2	297,5

* 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	4,0 %	4,7 %	2,4 %	3,3 %
15-35	4,3 %	4,4 %	4,1 %	4,3 %
36-60	-	4,5 %	3,9 %	4,0 %
61-90	-	5,5 %	3,7 %	3,9 %
91-180	4,0 %	4,0 %	4,1 %	4,1 %
>180	4,1 %	4,3 %	3,4 %	3,8 %
Total	4,2 %	4,5 %	3,3 %	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	114	3367	3024	19	146	2739	3437	6	78	1778	1964
Intragruppo y off-shore***	0	0	1865	1408	0	0	1921	674	0	0	1136	452
Otros	114	13	546	1346	146	19	901	1451	78	6	255	752
Total	128	128	5778	5778	164	164	5561	5561	84	84	3169	3169

* 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.