

Fecha de Publicación: 25 de agosto de 2014

Fecha de Información: 21 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\$1396,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.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	323,5	281,1	147,5	98,5	21,6	113,0	112,0
15-35	445,1	354,6	199,3	149,0	77,3	218,1	78,0
36-60	8,8	17,5	12,0	0,0	5,5	8,8	0,0
61-90	1,4	54,8	50,0	0,0	4,8	1,4	0,0
91-180	6,9	15,4	0,3	0,0	15,1	6,9	0,0
>180	39,1	69,9	25,0	0,8	13,5	7,0	31,4
Total	824,8	793,2	434,1	248,3	137,7	355,2	221,4

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

* 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	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**	12	113	3470	3077	20	142	2929	3571	6	77	1830	2080
Intragruppo y off-shore***	0	0	1890	1481	0	0	1969	692	0	0	1211	459
Otros	113	12	545	1347	142	20	924	1558	77	6	257	760
Total	125	125	5905	5905	162	162	5822	5822	84	84	3298	3298

* 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.