

Fecha de Publicación: 26 de agosto de 2014

Fecha de Información: 22 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\$1656,5 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	484,8	253,0	104,1	86,6	6,9	256,2	142,0
15-35	295,7	754,0	545,6	48,8	55,4	93,9	153,0
36-60	21,5	6,6	0,0	12,7	6,6	8,8	0,0
61-90	7,2	24,2	10,0	0,0	14,2	7,2	0,0
91-180	25,8	6,8	0,0	0,0	6,8	25,8	0,0
>180	32,6	39,4	15,0	0,0	24,4	32,6	0,0
Total	867,5	1084,0	674,7	148,1	114,3	424,4	295,0

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

Sector	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	112	3470	3084	20	142	3175	3698	6	77	2068	2204
Intragrupa y off-shore***	0	0	1890	1481	0	0	2002	779	0	0	1283	459
Otros	112	12	553	1347	142	20	926	1626	77	6	261	948
Total	124	124	5912	5912	163	163	6103	6103	84	84	3611	3611

* 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.