

Fecha de Publicación: 27 de agosto de 2014

Fecha de Información: 25 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\$1754,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	530,8	392,6	160,0	241,0	5,6	62,8	227,0
15-35	450,7	493,9	346,2	88,7	24,0	238,3	123,7
36-60	12,5	9,0	0,0	0,0	9,0	12,5	0,0
61-90	8,5	39,1	0,0	0,0	39,1	8,5	0,0
91-180	64,2	52,2	0,0	0,0	12,2	24,2	40,0
>180	48,8	82,7	40,0	0,3	2,7	8,5	40,0
Total	1115,6	1069,6	546,2	330,0	92,7	354,8	430,7

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

* 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: $((Tasa\ Pactada / Tasa\ de\ Contado) \wedge (360 / Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	25 al 29 de agosto				1 al 5 de septiembre				8 al 12 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	141	3628	3957	8	77	2132	2332	9	138	2471	2181
Intragruppo y off-shore***	0	0	2083	1020	0	0	1362	459	0	0	1349	761
Otros	141	21	927	1661	77	8	259	962	138	9	301	1179
Total	162	162	6638	6638	85	85	3753	3753	147	147	4121	4121

* 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.