

Fecha de Publicación: 29 de agosto de 2014

Fecha de Información: 27 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\$2128,8 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	598,5	175,0	66,5	443,5	8,5	55,0	100,0
15-35	408,1	773,2	542,6	130,5	111,6	158,6	119,0
36-60	83,8	98,4	52,3	30,0	6,1	13,8	40,0
61-90	77,4	100,0	0,0	0,0	100,0	77,4	0,0
91-180	9,9	35,5	0,0	0,0	35,5	9,9	0,0
>180	0,4	27,7	0,0	0,0	27,7	0,4	0,0
Total	1178,0	1209,7	661,4	604,0	289,4	315,0	259,0

* 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	4,0 %	3,5 %	2,2 %	2,7 %
15-35	3,7 %	4,2 %	4,1 %	4,1 %
36-60	4,2 %	4,6 %	4,1 %	4,2 %
61-90	-	4,6 %	4,1 %	4,4 %
91-180	-	4,7 %	3,7 %	4,5 %
>180	-	4,2 %	3,8 %	4,2 %
Total	3,9 %	4,2 %	3,0 %	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	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**	19	130	4174	4178	10	75	2289	2398	12	135	2619	2508
Intragruppo y off-shore***	0	0	2198	1514	0	0	1385	482	0	0	1586	797
Otros	130	19	955	1635	75	10	262	1056	135	12	342	1241
Total	149	149	7327	7327	85	85	3936	3936	147	147	4546	4546

* 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.