

Fecha de Publicación: 1 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 28 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\$1394,2 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	254,8	120,8	56,5	178,1	22,3	34,7	42,0
15-35	402,9	452,7	332,1	156,3	34,1	160,2	86,5
36-60	22,5	5,0	0,0	0,0	5,0	22,5	0,0
61-90	8,6	50,8	0,0	0,0	50,8	8,6	0,0
91-180	147,6	52,1	40,0	0,0	12,0	147,5	0,2
>180	2,3	2,8	0,0	0,3	2,8	2,0	0,0
Total	838,7	684,2	428,6	334,6	126,9	375,4	128,7

* 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	3,0 %	4,3 %	2,4 %	3,0 %
15-35	4,0 %	3,5 %	4,1 %	3,8 %
36-60	-	4,5 %	3,8 %	3,9 %
61-90	-	4,4 %	4,0 %	4,3 %
91-180	4,2 %	4,2 %	4,0 %	4,1 %
>180	-	4,7 %	3,4 %	4,1 %
Total	3,7 %	3,8 %	3,6 %	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	127	4335	4233	18	77	2322	2438	13	134	2676	2561
Intragruppo y off-shore***	0	0	2218	1644	0	0	1417	500	0	0	1619	827
Otros	127	19	962	1638	77	18	271	1071	134	13	347	1254
Total	146	146	7515	7515	95	95	4009	4009	148	148	4642	4642

* 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.