

Fecha de Publicación: 2 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 29 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\$1697,5 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	213,8	260,1	138,0	78,0	67,1	80,8	55,0
15-35	440,0	499,7	229,0	217,8	151,7	103,2	119,0
36-60	41,3	69,0	0,0	0,0	29,0	1,3	40,0
61-90	24,4	58,9	0,0	0,0	38,9	4,4	20,0
91-180	179,2	111,7	31,9	0,0	59,7	159,2	20,0
>180	21,5	42,0	10,0	10,0	22,0	1,5	10,0
Total	920,2	1041,3	408,9	305,8	368,4	350,5	264,0

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

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	105	4335	4252	19	82	2448	2641	14	141	2763	2609
Intragrupa y off-shore***	0	0	2218	1644	0	0	1555	514	0	0	1619	891
Otros	105	19	982	1638	82	19	281	1128	141	14	396	1277
Total	123	123	7535	7535	101	101	4283	4283	155	155	4778	4778

* 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.