

Fecha de Publicación: 11 de agosto de 2014

Fecha de Información: 06 de agosto de 2014¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1424,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	278,0	330,3	190,0	190,0	95,3	43,0	45,0
15-35	295,2	421,8	348,0	104,0	42,8	160,2	31,0
36-60	56,7	11,9	10,0	0,0	1,9	56,7	0,0
61-90	64,0	16,5	0,0	0,0	16,5	64,0	0,0
91-180	5,5	14,7	0,0	0,0	14,7	5,5	0,0
>180	3,9	5,3	0,0	0,0	2,3	0,9	3,0
Total	703,3	800,4	548,0	294,0	173,4	330,3	79,0

* 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	
3-14	3,8 %	4,2 %	2,8 %	3,4 %
15-35	3,9 %	3,8 %	3,8 %	3,8 %
36-60	-	4,4 %	3,8 %	3,8 %
61-90	-	4,5 %	3,7 %	3,8 %
91-180	-	3,9 %	3,6 %	3,8 %
>180	4,1 %	4,3 %	3,5 %	4,1 %
Total	3,8 %	3,9 %	3,4 %	3,7 %

*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	4 al 8 de agosto				11 al 15 de agosto				18 al 22 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	47	84	3714	3852	22	120	3171	3532	12	101	2297	1903
Intragrupo y off-shore***	0	1	1981	1211	0	0	2098	719	0	0	1076	884
Otros	84	45	570	1202	120	22	586	1605	101	12	448	1034
Total	130	130	6265	6265	142	142	5856	5856	113	113	3821	3821

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