

Fecha de Publicación: 19 de agosto de 2014

Fecha de Información: 14 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\$1175,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	191,2	136,8	61,0	105,3	34,8	44,9	41,0
15-35	379,9	301,5	239,5	158,0	19,0	178,9	43,0
36-60	32,2	9,5	5,3	0,0	4,2	32,2	0,0
61-90	1,0	84,9	3,4	0,0	81,5	1,0	0,0
91-180	35,0	48,7	20,0	35,0	28,7	0,0	0,0
>180	0,7	38,3	30,0	0,4	8,3	0,3	0,0
Total	640,1	619,6	359,2	298,7	176,4	257,4	84,0

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

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	11 al 15 de agosto				18 al 22 de agosto				25 al 29 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	124	3892	3806	12	114	2761	2643	11	134	2436	3236
Intragrupo y off-shore***	5	0	2241	1332	0	0	1570	989	0	0	1804	553
Otros	118	24	630	1624	114	12	539	1239	134	11	850	1302
Total	148	148	6763	6763	126	126	4870	4870	145	145	5091	5091

* 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.