

Fecha de Publicación: 3 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 01 de septiembre 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\$178,2 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	43,3	35,6	0,0	1,9	0,6	6,5	35,0
15-35	38,0	62,0	22,0	3,0	5,0	0,0	35,0
36-60	38,5	5,3	0,0	0,0	5,3	38,5	0,0
61-90	0,1	15,8	0,0	0,0	15,8	0,1	0,0
91-180	2,7	3,5	0,0	0,0	3,5	2,7	0,0
>180	0,0	3,4	0,0	0,0	3,4	0,0	0,0
Total	122,6	125,6	22,0	4,9	33,6	47,7	70,0

* 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	4,3 %	8,9 %	3,4 %	4,2 %
15-35	1,8 %	4,3 %	3,4 %	2,9 %
36-60	-	4,8 %	3,9 %	4,0 %
61-90	-	4,3 %	2,9 %	4,3 %
91-180	-	4,9 %	3,9 %	4,5 %
>180	-	4,4 %	-	4,4 %
Total	3,0 %	4,4 %	3,9 %	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	1 al 5 de septiembre				8 al 12 de septiembre				15 al 19 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	84	2450	2640	16	141	2802	2645	118	94	1987	2887
Intragrupo y off-shore***	0	0	1555	514	0	2	1619	891	0	0	1829	661
Otros	84	19	280	1130	141	14	396	1281	94	118	575	842
Total	102	102	4285	4285	156	156	4817	4817	212	212	4390	4390

* 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.