

Fecha de Publicación: 4 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 02 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\$1272,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.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	256,9	184,5	58,3	42,4	36,3	124,6	90,0
15-35	283,7	366,0	282,0	127,0	6,5	79,2	77,5
36-60	36,0	10,5	3,4	20,0	7,1	16,0	0,0
61-90	36,7	9,8	0,0	0,0	9,8	36,7	0,0
91-180	68,8	94,6	25,0	0,0	49,6	48,8	20,0
>180	12,2	110,0	90,0	0,0	10,0	2,2	10,0
Total	694,3	775,5	458,6	189,4	119,3	307,5	197,5

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

* 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	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	89	2565	2733	32	137	2920	2724	123	94	1994	2898
Intragruppo y off-shore***	0	0	1576	551	0	2	1635	891	0	0	1849	666
Otros	89	19	321	1178	137	30	399	1339	94	123	566	843
Total	108	108	4463	4463	169	169	4955	4955	217	217	4408	4408

* 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.