

Fecha de Publicación: 5 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 03 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\$1775,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	510,7	508,7	360,5	297,0	28,2	93,7	120,0
15-35	346,7	442,6	284,3	159,0	28,3	57,7	130,0
36-60	0,9	5,4	0,0	0,0	5,4	0,9	0,0
61-90	8,6	22,8	0,0	0,0	22,8	8,6	0,0
91-180	158,2	82,9	0,0	30,0	10,9	56,2	72,0
>180	1,2	9,2	0,0	0,0	9,2	1,2	0,0
Total	1026,3	1071,5	644,8	486,0	104,7	218,3	322,0

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

* 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	2864	2805	33	135	3013	3003	123	95	2168	3111
Intragruppo y off-shore***	0	0	1576	782	0	2	1872	937	0	0	2003	716
Otros	89	19	333	1186	135	31	401	1346	95	123	579	923
Total	109	109	4773	4773	168	168	5287	5287	218	218	4750	4750

* 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.