

Fecha de Publicación: 8 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 04 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\$2033,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	279,3	198,1	80,9	153,5	52,2	60,8	65,0
15-35	545,8	847,5	708,1	149,0	24,4	281,8	115,0
36-60	18,8	0,4	0,0	0,0	0,4	18,8	0,0
61-90	63,6	22,2	0,0	0,0	22,2	63,6	0,0
91-180	149,8	49,1	30,0	0,0	9,1	139,8	10,0
>180	37,7	21,4	6,0	21,4	5,4	6,3	10,0
Total	1095,0	1138,7	825,0	323,9	113,7	571,1	200,0

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

*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

Sector	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	91	2878	2855	36	143	3146	3053	123	97	2297	3220
Intragruppo y off-shore***	0	0	1604	813	0	2	1883	1018	0	0	2073	758
Otros	91	19	354	1168	143	34	414	1373	97	123	579	970
Total	110	110	4836	4836	178	178	5444	5444	219	219	4949	4949

* 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 intragruppo.