

Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 08 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\$1309,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	307,4	348,8	196,5	122,5	12,3	44,9	140,0
15-35	207,1	336,3	284,0	27,0	19,3	147,1	33,0
36-60	11,3	7,3	0,0	0,0	7,3	11,3	0,0
61-90	92,0	65,1	0,0	0,0	65,1	92,0	0,0
91-180	79,0	9,5	0,0	0,0	9,5	79,0	0,0
>180	14,9	3,6	0,0	0,0	3,6	14,9	0,0
Total	711,8	770,6	480,5	149,5	117,1	389,3	173,0

* 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	4,5 %	4,6 %	4,0 %	4,4 %
15-35	4,6 %	4,7 %	4,2 %	4,5 %
36-60	-	4,9 %	3,9 %	4,3 %
61-90	-	4,6 %	4,2 %	4,4 %
91-180	-	5,1 %	4,0 %	4,1 %
>180	-	4,5 %	3,9 %	4,0 %
Total	4,5 %	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	8 al 12 de septiembre				15 al 19 de septiembre				22 al 26 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	149	3513	3356	123	100	2394	3449	13	116	3032	2872
Intragrupa y off-shore***	0	2	1999	1166	4	0	2220	758	0	0	1607	826
Otros	149	34	455	1445	96	123	595	1002	116	13	544	1486
Total	185	185	5967	5967	223	223	5209	5209	128	128	5183	5183

* 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.