

Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 09 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\$1530,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.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	307,1	347,5	248,0	185,0	19,5	42,1	80,0
15-35	294,3	529,1	486,0	78,5	11,6	184,3	31,5
36-60	15,3	20,5	10,0	0,0	9,0	13,8	1,5
61-90	8,6	45,3	0,0	0,0	45,3	8,6	0,0
91-180	33,6	29,0	0,0	0,8	9,0	12,9	20,0
>180	23,1	9,6	0,0	0,4	9,6	22,8	0,0
Total	682,1	981,1	744,0	264,6	104,1	284,5	133,0

* 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	4,8 %	4,7 %	4,0 %	4,4 %
15-35	4,9 %	5,5 %	4,4 %	5,1 %
36-60	4,4 %	5,0 %	3,9 %	4,4 %
61-90	-	4,8 %	4,1 %	4,7 %
91-180	4,5 %	4,8 %	4,0 %	4,4 %
>180	-	4,5 %	3,8 %	4,0 %
Total	4,8 %	5,2 %	4,2 %	4,8 %

*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	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**	37	152	3662	3482	124	99	2540	3610	13	130	3074	2952
Intragrupa y off-shore***	0	2	2086	1278	4	0	2325	821	0	0	1687	841
Otros	152	35	464	1452	95	124	601	1035	130	13	544	1512
Total	189	189	6212	6212	223	223	5466	5466	142	142	5305	5305

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.