

Fecha de Publicación: 16 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 12 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\$1837,9 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	597,3	421,8	316,9	351,0	18,9	160,4	86,0
15-35	221,0	435,7	412,5	173,7	9,2	33,3	14,0
36-60	20,4	15,6	0,0	0,0	15,6	20,4	0,0
61-90	4,7	101,1	20,0	0,0	81,1	4,7	0,0
91-180	71,7	28,1	10,0	0,0	13,1	66,7	5,0
>180	12,5	12,9	3,0	0,7	9,9	11,8	0,0
Total	927,7	1015,2	762,4	525,4	147,8	297,3	105,0

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

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.

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**	38	155	3913	3547	127	111	3460	4032	13	133	3274	3443
Intragruppo y off-shore***	0	2	2125	1515	4	0	2596	1376	0	0	2127	854
Otros	155	36	490	1466	107	127	629	1277	133	13	545	1649
Total	192	192	6528	6528	238	238	6685	6685	146	146	5946	5946

* 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.