

Fecha de Publicación: 12 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 10 de septiembre de 2014¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1603,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	197,7	84,4	67,0	163,5	16,4	33,2	1,0
15-35	375,3	529,5	465,4	126,0	20,1	205,3	44,0
36-60	61,2	13,9	0,0	0,0	13,9	61,2	0,0
61-90	3,1	26,9	0,0	0,0	26,9	3,1	0,0
91-180	82,5	178,6	0,0	0,0	178,6	82,5	0,0
>180	56,4	39,1	15,0	41,3	24,1	15,0	0,0
Total	776,2	872,3	547,4	330,8	280,0	400,3	45,0

* 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	
3-14	3,5 %	5,2 %	2,7 %	3,3 %
15-35	5,0 %	5,1 %	4,6 %	4,9 %
36-60	-	5,1 %	2,0 %	2,5 %
61-90	-	4,9 %	4,0 %	4,8 %
91-180	-	4,6 %	4,3 %	4,5 %
>180	-	3,9 %	4,1 %	4,0 %
Total	4,9 %	4,9 %	3,9 %	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**

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	151	3807	3507	125	101	2589	3678	13	131	3181	3003
Intragrupo y off-shore***	0	2	2094	1418	4	0	2380	842	0	0	1731	843
Otros	151	35	481	1457	97	125	613	1061	131	13	551	1617
Total	188	188	6382	6382	226	226	5582	5582	143	143	5463	5463

* 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 intragrupo.