

Fecha de Publicación: 18 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 16 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\$1873,7 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	337,1	397,9	268,0	125,0	81,9	164,1	48,0
15-35	750,8	372,9	147,6	456,0	16,2	85,7	209,1
36-60	30,6	64,2	30,0	0,0	9,2	5,6	25,0
61-90	9,5	42,5	0,0	0,0	42,4	9,5	0,0
91-180	29,8	81,1	1,4	10,0	79,5	19,6	0,2
>180	29,2	10,4	0,0	25,0	10,4	4,2	0,0
Total	1187,0	969,0	447,0	616,0	239,6	288,7	282,4

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	15 al 19 de septiembre				22 al 26 de septiembre				29 de sep. al 3 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	66	130	3832	4463	19	137	3686	3639	39	83	1996	2397
Intragruppo y off-shore***	4	0	2945	1601	0	0	2236	1077	0	0	1265	781
Otros	126	66	643	1356	137	19	582	1789	83	39	503	586
Total	196	196	7420	7420	157	157	6504	6504	122	122	3764	3764

* 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.