

Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 17 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\$1529,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.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	319,3	269,3	217,5	242,5	31,8	56,8	20,0
15-35	381,4	413,2	331,1	158,7	22,1	162,7	60,0
36-60	36,8	43,5	10,0	0,0	8,5	11,8	25,0
61-90	21,1	24,5	0,0	0,0	24,5	21,1	0,0
91-180	83,0	31,1	0,0	0,0	16,1	68,0	15,0
>180	18,6	22,4	3,0	0,0	4,4	3,6	15,0
Total	860,2	804,0	561,6	401,2	107,4	324,0	135,0

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

*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	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	132	4076	4540	20	147	3753	3808	40	84	2087	2426
Intragruppo y off-shore***	4	0	3018	1839	0	0	2380	1078	0	0	1270	784
Otros	128	66	647	1362	147	20	587	1834	84	40	512	659
Total	198	198	7742	7742	167	167	6720	6720	124	124	3869	3869

* 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 intragruppo.