

Fecha de Publicación: 22 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 18 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\$1374,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.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	281,7	366,9	196,0	77,0	22,9	56,7	148,0
15-35	394,5	388,5	293,5	95,1	15,0	219,4	80,0
36-60	1,2	16,1	0,0	0,0	16,1	1,2	0,0
61-90	45,9	26,1	0,0	0,2	26,1	45,8	0,0
91-180	22,6	20,9	0,0	0,0	10,9	12,6	10,0
>180	16,4	41,9	25,0	0,0	6,9	6,4	10,0
Total	762,3	860,3	514,5	172,3	97,8	342,0	248,0

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

*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

Sector	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	134	4214	4606	20	150	3847	3924	40	85	2138	2607
Intragruppo y off-shore***	4	0	3028	1916	0	0	2404	1078	0	0	1432	784
Otros	130	66	650	1370	150	20	604	1853	85	40	511	690
Total	200	200	7892	7892	170	170	6855	6855	125	125	4081	4081

* 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.