

Fecha de Publicación: 23 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 19 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\$1165,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	181,3	114,5	9,0	5,5	25,5	95,8	80,0
15-35	434,2	436,9	173,5	85,2	112,4	198,0	151,0
36-60	1,0	63,3	0,0	0,0	63,3	1,0	0,0
61-90	1,1	18,0	2,0	0,0	16,0	1,1	0,0
91-180	35,2	37,3	0,0	0,0	17,3	15,2	20,0
>180	27,0	86,6	20,0	0,0	46,6	7,0	20,0
Total	679,8	756,7	204,5	90,7	281,2	318,1	271,0

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

*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		Delivery		NDF					
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V				
Sector Financiero**	66	137	4197	4602	34	153	3939	3991	40	87	2229	2650								
Intragrupa y off-shore***	4	0	3028	1916	0	0	2413	1081	0	0	1432	787								
Otros	133	66	645	1353	153	34	613	1892	87	40	524	749								
Total	203	203	7871	7871	186	186	6965	6965	127	127	4185	4185								

* 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 intragrupo.