

Fecha de Publicación: 24 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 22 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\$1306,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	302,3	304,3	127,5	113,0	78,8	91,3	98,0
15-35	298,6	342,2	267,8	146,0	13,5	91,6	61,0
36-60	49,0	6,2	0,0	0,0	6,2	49,0	0,0
61-90	8,5	25,4	0,0	0,0	25,4	8,5	0,0
91-180	107,7	23,8	0,0	0,0	3,8	87,7	20,0
>180	14,7	3,1	0,0	0,3	3,1	14,4	0,0
Total	780,9	705,0	395,3	259,3	130,7	342,5	179,0

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	22 al 26 de septiembre				29 de sep. al 3 de octubre				6 al 10 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	59	151	4091	4141	40	89	2336	2780	16	117	2615	3216
Intragruppo y off-shore***	0	0	2484	1184	0	0	1482	797	0	0	2208	810
Otros	151	59	640	1889	89	40	575	817	117	16	496	1292
Total	210	210	7214	7214	128	128	4393	4393	133	133	5319	5319

* 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.