

Fecha de Publicación: 25 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 23 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\$981,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	105,3	84,5	12,3	43,5	47,2	36,9	25,0
15-35	368,8	380,8	238,1	159,3	44,7	111,6	98,0
36-60	14,5	8,5	2,5	0,0	6,0	14,5	0,0
61-90	43,8	2,0	0,0	0,0	2,0	43,8	0,0
91-180	56,9	13,2	0,1	0,0	3,2	46,9	10,0
>180	29,0	6,7	0,0	0,0	6,7	29,0	0,0
Total	618,3	495,7	252,9	202,7	109,8	282,6	133,0

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

*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	157	4153	4169	40	92	2369	2808	16	117	2745	3334
Intragrupa y off-shore***	0	0	2490	1220	0	0	1482	805	0	0	2277	863
Otros	157	59	661	1915	92	40	588	827	117	16	530	1354
Total	216	216	7304	7304	132	132	4440	4440	133	133	5552	5552

* 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.