

Fecha de Publicación: 26 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 24 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\$1247,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	231,2	139,8	79,0	188,5	50,8	32,7	10,0
15-35	222,6	480,7	464,0	141,5	11,7	76,1	5,0
36-60	13,7	8,8	0,0	0,0	8,8	13,7	0,0
61-90	17,1	32,3	25,0	10,0	7,3	7,1	0,0
91-180	47,4	7,1	0,0	0,0	7,1	47,4	0,0
>180	52,7	19,4	5,0	20,0	4,4	22,7	10,0
Total	584,7	687,9	573,0	360,0	89,9	199,7	25,0

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

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**	58	161	4310	4258	38	94	2433	2848	17	118	2760	3341
Intragrupa y off-shore***	0	0	2550	1366	0	0	1501	844	0	0	2279	866
Otros	161	58	680	1916	94	38	609	852	118	17	534	1366
Total	219	219	7540	7540	132	132	4544	4544	135	135	5574	5574

* 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.