

Fecha de Publicación: 29 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 25 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\$1681,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.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	457,1	132,3	54,0	323,0	29,8	85,6	48,5
15-35	458,9	418,6	333,0	168,0	33,1	238,4	52,5
36-60	30,0	2,3	0,0	0,0	2,3	30,0	0,0
61-90	38,5	58,4	10,0	10,2	38,4	18,3	10,0
91-180	31,1	76,5	0,0	0,2	76,5	30,9	0,0
>180	26,9	61,7	50,0	7,2	11,7	19,7	0,0
Total	1042,4	749,9	447,0	508,5	191,9	422,9	111,0

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

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. 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**	57	158	4470	4316	39	98	2613	2883	57	118	2842	3391
Intragruppo y off-shore***	0	0	2604	1517	0	0	1501	976	0	0	2296	906
Otros	158	57	682	1923	98	39	614	870	118	57	551	1392
Total	215	215	7756	7756	137	137	4728	4728	175	175	5689	5689

* 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.