

Fecha de Publicación: 1 de octubre de 2014

Fecha de Información: 29 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\$1454,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.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	267,7	250,3	115,9	84,6	10,4	59,2	124,0
15-35	626,3	243,5	106,1	445,3	9,4	53,1	128,0
36-60	68,3	136,9	115,0	0,1	1,9	48,2	20,0
61-90	6,9	25,2	0,0	0,0	21,2	2,9	4,0
91-180	16,2	26,1	20,0	0,1	6,1	16,1	0,0
>180	40,7	42,2	20,0	10,0	2,2	10,7	20,0
Total	1026,1	724,2	376,9	540,0	51,2	190,1	296,0

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

* 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	29 de sep. al 3 de octubre				6 al 10 de octubre				13 al 17 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	55	87	2943	3124	66	125	3080	3614	27	115	2469	1981
Intragruppo y off-shore***	0	0	1619	1176	0	0	2390	990	0	0	1184	1177
Otros	87	55	647	909	125	66	577	1442	115	27	221	715
Total	142	142	5209	5209	190	190	6046	6046	143	143	3873	3873

* 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.