

Fecha de Publicación: 2 de octubre de 2014

Fecha de Información: 30 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\$1498,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	397,5	265,9	18,0	95,5	37,9	92,0	210,0
15-35	398,5	323,7	189,0	278,5	95,7	81,0	39,0
36-60	74,4	62,6	30,0	15,0	17,6	44,4	15,0
61-90	14,6	45,0	10,0	10,0	35,0	4,6	0,0
91-180	101,7	32,8	20,0	0,0	12,8	101,7	0,0
>180	23,8	24,4	10,0	18,0	12,4	3,8	2,0
Total	1010,4	754,4	277,0	417,0	211,4	327,4	266,0

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

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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**	56	88	3087	3212	71	125	3307	3763	27	116	2490	2036
Intragruppo y off-shore***	0	0	1629	1246	0	0	2398	1015	0	0	1207	1177
Otros	88	56	665	923	125	71	588	1514	115	27	233	715
Total	144	144	5380	5380	196	196	6292	6292	143	143	3929	3929

* 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.

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 intragruppo.