

Fecha de Publicación: 3 de octubre de 2014

Fecha de Información: 01 de octubre 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\$1435,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	378,2	243,7	111,3	230,9	29,4	44,2	103,0
15-35	158,3	558,6	418,7	79,0	73,9	13,3	66,0
36-60	5,9	4,9	0,0	0,0	4,9	5,9	0,0
61-90	84,9	62,5	23,9	30,3	35,6	51,6	3,0
91-180	63,0	18,4	0,0	0,0	18,4	63,0	0,0
>180	4,9	24,1	15,0	0,8	9,1	4,1	0,0
Total	695,2	912,0	568,9	341,0	171,1	182,1	172,0

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

*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

Sector	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	95	3293	3261	71	131	3427	3898	28	119	2542	2128
Intragrupa y off-shore***	0	0	1665	1449	0	0	2473	1043	0	0	1248	1177
Otros	95	55	678	926	131	71	595	1554	119	28	233	717
Total	151	151	5637	5637	202	202	6495	6495	147	147	4022	4022

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.