

Fecha de Publicación: 7 de octubre de 2014

Fecha de Información: 03 de octubre de 2014¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1520,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	465,7	328,4	139,0	290,0	42,7	29,0	146,7
15-35	298,8	519,9	385,0	128,0	53,9	89,8	81,0
36-60	1,3	16,9	13,0	0,0	3,9	1,3	0,0
61-90	21,1	18,1	15,1	0,0	3,0	21,1	0,0
91-180	29,9	37,4	0,0	0,4	37,4	29,5	0,0
>180	7,9	2,9	0,0	0,0	2,9	7,9	0,0
Total	824,7	923,6	552,1	418,4	143,8	178,6	227,7

* 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	
3-14	3,5 %	3,7 %	2,9 %	3,3 %
15-35	3,4 %	2,9 %	2,6 %	2,9 %
36-60	-	4,7 %	3,1 %	4,5 %
61-90	-	3,9 %	3,5 %	3,7 %
91-180	-	1,7 %	3,6 %	2,6 %
>180	-	4,0 %	3,4 %	3,6 %
Total	3,5 %	3,2 %	2,8 %	3,1 %

*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**	55	95	3304	3281	78	131	3940	4306	32	121	2755	2332
Intragrupo y off-shore***	0	0	1672	1449	0	0	2730	1396	0	0	1358	1288
Otros	95	55	681	926	131	78	655	1623	121	32	237	729
Total	150	150	5657	5657	209	209	7325	7325	153	153	4349	4349

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.