

Fecha de Publicación: 9 de octubre de 2014

Fecha de Información: 07 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\$1564,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	294,1	292,7	203,0	213,0	24,7	16,1	65,0
15-35	471,5	578,9	333,8	110,0	38,6	155,0	206,5
36-60	11,3	13,4	0,0	0,0	13,4	11,3	0,0
61-90	7,6	6,2	0,0	0,0	6,2	7,6	0,0
91-180	96,6	34,0	20,0	30,0	9,0	61,6	5,0
>180	16,8	18,0	17,0	0,0	1,0	16,8	0,0
Total	897,9	943,2	573,8	353,0	92,9	268,4	276,5

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

*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	6 al 10 de octubre				13 al 17 de octubre				20 al 24 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	40	147	4326	4538	34	129	2864	2630	34	159	2326	2902
Intragrupo y off-shore***	0	0	2837	1607	0	0	1586	1349	0	0	1926	907
Otros	147	40	670	1687	128	34	286	757	159	34	454	898
Total	187	187	7833	7833	162	162	4736	4736	193	193	4707	4707

* 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.