

Fecha de Publicación: 14 de octubre de 2014

Fecha de Información: 08 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\$2538,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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 | 382,9 | 440,1 | 357,0 | 282,5 | 63,1 | 80,4 | 20,0 |
| 15-35 | 561,5 | 932,0 | 575,5 | 192,9 | 157,8 | 169,8 | 198,8 |
| 36-60 | 22,7 | 8,8 | 0,0 | 0,0 | 8,8 | 22,7 | 0,0 |
| 61-90 | 29,6 | 15,5 | 0,0 | 0,0 | 15,5 | 29,6 | 0,0 |
| 91-180 | 249,0 | 130,4 | 30,0 | 30,0 | 25,4 | 144,0 | 75,0 |
| >180 | 35,5 | 44,2 | 12,0 | 0,0 | 12,2 | 15,5 | 20,0 |
| Total | 1281,2 | 1571,1 | 974,5 | 505,4 | 282,9 | 462,0 | 313,8 |

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

*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 | 137 | 4805 | 4802 | 40 | 132 | 3095 | 3048 | 36 | 161 | 2451 | 3294 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 3011 | 1996 | 0 | 0 | 1900 | 1411 | 0 | 0 | 2137 | 950 |
| Otros | 137 | 40 | 679 | 1697 | 132 | 40 | 330 | 867 | 161 | 36 | 591 | 934 |
| Total | 177 | 177 | 8494 | 8494 | 172 | 172 | 5326 | 5326 | 196 | 196 | 5179 | 5179 |

* 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.