

Fecha de Publicación: 15 de octubre de 2014

Fecha de Información: 10 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\$1548,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	257,7	442,5	290,3	116,0	40,7	30,2	111,5
15-35	451,7	323,2	230,5	245,4	8,7	122,3	84,0
36-60	11,9	34,4	25,0	0,0	4,4	6,9	5,0
61-90	9,0	44,3	15,0	0,8	29,3	8,2	0,0
91-180	37,2	135,2	90,0	1,0	15,2	6,2	30,0
>180	19,6	12,1	0,0	0,0	12,1	19,6	0,0
Total	787,1	991,6	650,8	363,2	110,3	193,3	230,5

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

*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	133	4805	4803	39	132	3294	3342	36	188	2510	3414
Intragrupo y off-shore***	0	0	3011	1996	0	0	2106	1511	0	0	2221	966
Otros	133	40	681	1697	132	39	332	880	188	36	601	952
Total	173	173	8496	8496	170	170	5733	5733	224	224	5332	5332

* 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.