

Fecha de Publicación: 20 de octubre de 2014

Fecha de Información: 16 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\$1215,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	211,3	275,5	123,0	10,0	32,5	81,3	120,0
15-35	414,6	406,3	248,9	135,5	17,4	139,1	140,0
36-60	33,4	62,3	0,0	0,0	42,3	13,4	20,0
61-90	3,0	9,4	0,0	0,0	9,4	3,0	0,0
91-180	15,5	10,4	0,0	0,0	10,4	15,5	0,0
>180	40,4	23,8	5,1	2,8	8,7	27,6	10,0
Total	718,2	787,6	377,0	148,3	120,6	279,9	290,0

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

*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	13 al 17 de octubre				20 al 24 de octubre				27 al 31 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	167	3607	3491	43	204	2848	3849	47	97	2692	2641
Intragrupo y off-shore***	0	0	2139	1712	0	0	2400	1016	0	0	1383	1208
Otros	166	37	349	892	204	43	731	1114	97	47	619	845
Total	204	204	6095	6095	247	247	5979	5979	145	145	4694	4694

* 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.