

Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2014

Fecha de Información: 20 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\$1760,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.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	415,7	409,3	353,0	311,0	5,3	53,7	51,0
15-35	344,5	489,7	389,0	205,0	6,5	45,3	94,3
36-60	35,6	4,0	0,0	0,0	4,0	35,6	0,0
61-90	2,7	3,2	0,0	0,0	3,2	2,7	0,0
91-180	95,6	130,0	4,5	42,0	85,5	13,6	40,0
>180	2,4	12,8	0,0	0,0	12,8	2,4	0,0
Total	896,5	1049,0	746,5	558,0	117,2	153,3	185,3

* 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	13,9 %	4,3 %	3,1 %	4,4 %
15-35	4,6 %	4,7 %	4,5 %	4,6 %
36-60	-	5,2 %	4,1 %	4,3 %
61-90	-	4,4 %	4,0 %	4,2 %
91-180	4,0 %	4,3 %	4,0 %	4,2 %
>180	-	4,2 %	3,5 %	4,1 %
Total	7,0 %	4,4 %	3,8 %	4,5 %

*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	20 al 24 de octubre				27 al 31 de octubre				3 al 7 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	195	3262	3989	48	100	2945	3054	11	81	2316	2823
Intragrupo y off-shore***	0	0	2468	1344	0	0	1729	1236	0	0	1696	757
Otros	195	44	766	1162	100	48	633	1016	80	11	420	852
Total	239	239	6495	6495	148	148	5307	5307	92	92	4432	4432

* 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.