

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2014

Fecha de Información: 21 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\$1642,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,7%.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	346,3	316,2	228,0	256,5	40,7	42,3	47,5
15-35	586,6	399,2	232,0	273,5	29,7	175,6	137,5
36-60	27,9	30,5	0,0	0,0	20,5	17,9	10,0
61-90	10,1	10,0	0,0	0,0	10,0	10,1	0,0
91-180	49,8	54,4	0,0	0,0	29,4	24,8	25,0
>180	24,5	10,8	0,0	20,0	6,8	0,5	4,0
Total	1045,4	821,0	460,0	550,0	137,0	271,4	224,0

* 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	Compras	Ventas	
3-14	2,7 %	5,7 %	10,7 %	7,8 %
15-35	3,9 %	4,7 %	4,4 %	4,4 %
36-60	4,2 %	5,4 %	4,0 %	4,7 %
61-90	-	3,6 %	3,9 %	3,7 %
91-180	3,9 %	4,6 %	4,0 %	4,2 %
>180	4,0 %	4,7 %	3,9 %	4,1 %
Total	3,7 %	5,2 %	6,8 %	5,7 %

*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	194	3544	4073	47	109	3007	3260	11	81	2377	2889
Intragrupo y off-shore***	0	0	2498	1580	0	0	1911	1257	0	0	1751	796
Otros	194	44	786	1176	108	47	642	1043	81	11	422	864
Total	239	239	6829	6829	156	156	5561	5561	92	92	4550	4550

* 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.