

Fecha de Publicación: 6 de octubre de 2014

Fecha de Información: 02 de octubre de 2014 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1540,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	280,4	297,0	228,8	174,3	24,2	62,2	44,0
15-35	372,9	384,1	324,0	223,3	32,1	121,7	28,0
36-60	11,9	69,6	57,0	0,0	12,6	11,9	0,0
61-90	54,9	56,1	1,3	15,0	15,9	0,9	39,0
91-180	63,2	45,5	0,0	0,8	15,5	32,4	30,0
>180	10,4	45,9	35,0	0,0	0,9	0,4	10,0
Total	793,7	898,2	646,0	413,3	101,2	229,4	151,0

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

*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

Sector	29 de sep. al 3 de octubre				6 al 10 de octubre				13 al 17 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	56	96	3303	3280	74	135	3637	4162	29	118	2600	2148
Intragruppo y off-shore***	0	0	1672	1449	0	0	2683	1165	0	0	1266	1229
Otros	96	56	681	926	135	74	614	1607	118	29	234	723
Total	151	151	5656	5656	208	208	6934	6934	146	146	4100	4100

* 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 intragruppo.