

Fecha de Publicación: 8 de octubre de 2014

Fecha de Información: 06 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\$1336,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	212,0	323,9	191,5	104,5	66,4	41,5	66,0
15-35	402,6	384,5	236,5	220,0	72,0	106,6	76,0
36-60	5,0	1,7	0,0	0,0	1,7	5,0	0,0
61-90	13,3	14,7	0,0	0,0	14,7	13,3	0,0
91-180	57,7	92,2	0,1	0,0	52,1	17,7	40,0
>180	2,0	8,3	7,0	0,0	1,3	2,0	0,0
Total	692,6	825,4	435,1	324,5	208,4	186,1	182,0

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

*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	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	132	4135	4492	34	127	2806	2432	34	154	2266	2867
Intragruppo y off-shore***	0	0	2837	1469	0	0	1413	1319	0	0	1891	850
Otros	132	40	668	1679	126	34	282	750	154	34	455	895
Total	172	172	7640	7640	160	160	4502	4502	188	188	4612	4612

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.