

Fecha de Publicación: 14 de octubre de 2014

Fecha de Información: 09 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\$1976,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	404,1	433,7	260,0	188,0	43,5	85,9	130,2
15-35	446,5	739,8	497,6	116,0	114,2	202,5	128,0
36-60	6,5	1,2	0,0	0,0	1,2	6,5	0,0
61-90	15,4	16,7	4,2	0,0	2,5	5,4	10,0
91-180	82,9	72,1	20,0	0,0	32,1	62,9	20,0
>180	11,0	35,2	30,0	0,0	5,2	11,0	0,0
Total	966,4	1298,6	811,8	304,0	198,6	374,2	288,2

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

*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	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	137	4805	4802	40	132	3095	3048	36	161	2451	3294
Intragrupo y off-shore***	0	0	3011	1996	0	0	1900	1411	0	0	2137	950
Otros	137	40	679	1697	132	40	330	867	161	36	591	934
Total	177	177	8494	8494	172	172	5326	5326	196	196	5179	5179

* 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 intragrupo.