

Fecha de Publicación: 17 de octubre de 2014

Fecha de Información: 15 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\$1603,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	354,0	273,2	102,0	182,0	75,2	76,0	96,0
15-35	287,4	544,1	468,0	153,0	19,6	77,9	56,5
36-60	0,6	19,5	0,0	0,0	19,5	0,6	0,0
61-90	1,3	2,6	0,0	0,0	2,6	1,3	0,0
91-180	74,9	72,6	0,0	15,3	57,6	44,6	15,0
>180	88,3	52,7	50,1	67,7	2,7	20,6	0,0
Total	806,5	964,7	620,1	418,0	177,2	221,0	167,5

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

Sector	13 al 17 de octubre				20 al 24 de octubre				27 al 31 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	39	156	3600	3486	39	191	2710	3635	47	99	2623	2543
Intragrupa y off-shore***	0	0	2139	1712	0	0	2325	1006	0	0	1331	1208
Otros	156	39	343	884	191	39	672	1066	99	47	613	816
Total	195	195	6082	6082	229	229	5707	5707	146	146	4567	4567

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