

Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2014

Fecha de Información: 22 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\$1457,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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 | 374,9 | 134,0 | 74,0 | 308,0 | 36,0 | 42,9 | 24,0 |
| 15-35 | 386,3 | 539,7 | 361,6 | 164,5 | 77,2 | 120,8 | 101,0 |
| 36-60 | 9,4 | 6,1 | 0,0 | 0,0 | 6,1 | 9,4 | 0,0 |
| 61-90 | 16,0 | 11,9 | 0,0 | 0,0 | 11,9 | 16,0 | 0,0 |
| 91-180 | 32,8 | 18,5 | 0,0 | 7,0 | 18,5 | 25,8 | 0,0 |
| >180 | 25,4 | 42,4 | 0,0 | 0,0 | 27,4 | 10,4 | 15,0 |
| Total | 844,9 | 752,6 | 435,6 | 479,5 | 177,0 | 225,4 | 140,0 |

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

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

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 | 193 | 3822 | 4085 | 48 | 112 | 3086 | 3347 | 12 | 80 | 2452 | 3026 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2500 | 1853 | 0 | 0 | 1983 | 1292 | 0 | 0 | 1799 | 796 |
| Otros | 193 | 44 | 796 | 1181 | 112 | 48 | 647 | 1077 | 80 | 12 | 441 | 870 |
| Total | 237 | 237 | 7119 | 7119 | 160 | 160 | 5717 | 5717 | 92 | 92 | 4692 | 4692 |

* 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.