

Fecha de Publicación: 27 de octubre de 2014

Fecha de Información: 23 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\$1579,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.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	175,1	210,3	151,0	118,0	59,3	57,1	0,0
15-35	329,2	676,9	533,3	84,5	58,4	159,5	85,3
36-60	53,0	24,3	10,0	30,0	14,3	23,0	0,0
61-90	32,1	4,2	0,0	20,0	4,2	12,1	0,0
91-180	34,4	130,8	13,0	0,0	97,8	14,4	20,0
>180	12,2	12,2	0,0	0,0	2,2	2,2	10,0
Total	636,1	1058,7	707,3	252,5	236,2	268,4	115,3

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

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. 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	191	3848	4096	48	116	3235	3448	12	78	2452	3154
Intragruppo y off-shore***	0	0	2500	1878	0	0	2031	1385	0	0	1922	796
Otros	191	44	807	1182	116	48	700	1132	78	12	446	870
Total	234	234	7156	7156	165	165	5966	5966	90	90	4821	4821

* 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.