

Fecha de Publicación: 28 de octubre de 2014

Fecha de Información: 24 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\$851,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.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	169,8	96,3	25,5	98,0	30,8	31,8	40,0
15-35	198,8	330,6	314,0	75,0	5,1	112,3	11,6
36-60	19,8	12,7	1,0	0,0	11,7	19,8	0,0
61-90	7,8	6,8	0,0	0,1	6,8	7,7	0,0
91-180	2,6	29,4	20,0	0,0	9,4	2,6	0,0
>180	27,6	1,3	0,1	0,0	1,2	27,6	0,0
Total	426,4	477,0	360,6	173,1	64,9	201,8	51,6

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

* 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	190	3848	4110	46	116	3369	3496	13	77	2488	3189
Intragruppo y off-shore***	0	0	2500	1878	0	0	2043	1474	0	0	1936	805
Otros	190	44	822	1182	116	46	716	1158	77	13	447	877
Total	233	233	7170	7170	162	162	6128	6128	90	90	4871	4871

* 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.