

Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2014

Fecha de Información: 27 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\$1168,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.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	231,1	163,7	125,5	185,3	12,2	19,9	26,0
15-35	275,5	431,5	303,5	91,5	24,0	80,0	104,0
36-60	6,2	15,6	0,0	0,0	15,6	6,2	0,0
61-90	29,7	0,9	0,0	0,0	0,9	29,7	0,0
91-180	98,2	5,6	0,0	0,0	5,6	98,2	0,0
>180	40,2	0,6	0,0	0,0	0,6	40,2	0,0
Total	680,9	617,9	429,0	276,8	58,9	274,2	130,0

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

* 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	27 al 31 de octubre				3 al 7 de noviembre				10 al 14 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	46	120	3572	3607	13	78	2517	3240	28	91	1912	2468
Intragruppo y off-shore***	0	0	2138	1659	0	0	1966	805	0	0	1774	731
Otros	120	46	726	1169	78	13	447	885	91	28	372	859
Total	166	166	6435	6435	91	91	4930	4930	118	118	4058	4058

* 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.