

Fecha de Publicación: 31 de octubre de 2014

Fecha de Información: 29 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\$1737,0 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	275,1	153,1	69,3	134,3	83,8	140,8	0,0
15-35	635,8	447,3	336,5	522,0	50,3	53,3	60,5
36-60	11,3	32,6	0,0	3,5	27,6	2,8	5,0
61-90	14,3	14,1	0,0	0,0	14,1	14,3	0,0
91-180	52,0	80,9	0,0	0,0	75,9	47,0	5,0
>180	45,0	60,9	10,0	0,0	35,9	30,0	15,0
Total	1033,5	789,0	415,8	659,8	287,7	288,2	85,5

* 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	-	4,5 %	3,8 %	4,0 %
15-35	2,7 %	4,3 %	4,0 %	4,0 %
36-60	3,9 %	-0,6 %	3,7 %	0,4 %
61-90	-	4,3 %	3,8 %	4,1 %
91-180	0,0 %	4,1 %	3,7 %	3,8 %
>180	3,9 %	4,1 %	3,7 %	3,9 %
Total	2,8 %	4,1 %	3,9 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	99	3759	3754	13	84	2697	3358	28	94	2003	2586
Intragruppo y off-shore***	0	0	2244	1809	0	0	1974	876	0	0	1837	768
Otros	99	46	751	1191	84	13	551	989	94	28	411	897
Total	145	145	6753	6753	98	98	5223	5223	122	122	4251	4251

* 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.