

Fecha de Publicación: 4 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 30 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\$1137,3 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	89,7	151,6	117,0	38,0	34,6	51,7	0,0
15-35	300,0	493,3	349,0	138,0	12,3	30,0	132,0
36-60	51,5	66,4	0,0	0,0	19,4	4,5	47,0
61-90	8,2	5,6	0,0	0,0	5,6	8,2	0,0
91-180	59,9	13,6	0,0	18,0	13,6	41,9	0,0
>180	65,7	10,7	0,0	44,0	10,7	21,7	0,0
Total	575,0	741,3	466,0	238,0	96,3	158,0	179,0

* 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	-	4,5 %	3,8 %	4,2 %
15-35	3,0 %	4,4 %	4,0 %	4,0 %
36-60	1,7 %	4,4 %	3,7 %	2,6 %
61-90	-	4,4 %	3,7 %	4,0 %
91-180	-	3,5 %	3,7 %	3,7 %
>180	-	4,2 %	3,7 %	3,9 %
Total	2,7 %	4,4 %	3,8 %	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	3774	3793	25	87	2748	3436	43	96	2005	2616
Intragruppo y off-shore***	0	0	2269	1822	0	0	2029	901	0	0	1874	768
Otros	99	46	765	1194	87	25	573	1015	96	43	405	899
Total	145	145	6809	6809	113	113	5351	5351	139	139	4284	4284

* 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.