

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.