

Fecha de Publicación: 7 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 05 de noviembre 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\$2602,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.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	617,1	282,6	202,0	501,2	1,6	36,9	79,0
15-35	362,4	1055,4	892,2	136,0	32,2	95,4	131,0
36-60	8,5	5,9	0,0	0,0	5,9	8,5	0,0
61-90	23,2	4,5	0,0	0,0	4,5	23,2	0,0
91-180	185,7	251,8	10,1	5,0	111,7	50,7	130,0
>180	105,1	60,2	40,0	52,9	0,2	32,2	20,0
Total	1302,0	1660,5	1144,3	695,1	156,2	246,9	360,0

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

* 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	3 al 7 de noviembre				10 al 14 de noviembre				17 al 21 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	92	3564	3767	46	101	2318	2900	36	103	2115	2484
Intragruppo y off-shore***	0	0	2216	1483	0	0	1989	793	0	0	1589	946
Otros	92	29	561	1089	101	46	422	1035	103	36	495	769
Total	121	121	6340	6340	147	147	4729	4729	139	139	4200	4200

* 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.