

Fecha de Publicación: 10 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 06 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\$2498,4 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	411,2	341,1	197,7	147,0	3,3	124,2	140,0
15-35	543,2	1179,7	898,8	109,5	93,0	245,7	188,0
36-60	13,0	9,4	0,0	0,0	9,4	13,0	0,0
61-90	31,3	12,1	0,0	5,3	7,1	21,0	5,0
91-180	113,3	27,2	0,0	43,6	7,2	49,7	20,0
>180	124,7	70,2	20,0	15,0	25,2	84,7	25,0
Total	1236,8	1639,6	1116,5	320,4	145,1	538,3	378,0

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	94	3671	3784	47	103	2455	3080	38	103	2294	2656
Intragruppo y off-shore***	0	0	2233	1589	0	0	2090	834	0	0	1694	946
Otros	94	29	560	1091	103	47	422	1052	103	38	497	884
Total	123	123	6464	6464	149	149	4967	4967	142	142	4486	4486

* 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.