

Fecha de Publicación: 12 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 10 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\$1096,1 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	191,9	200,6	154,9	111,2	5,0	40,0	40,7
15-35	213,1	223,1	174,5	161,0	38,6	42,1	10,0
36-60	19,1	44,9	15,0	0,0	19,9	9,1	10,0
61-90	22,4	80,9	0,0	0,0	80,9	22,4	0,0
91-180	85,9	42,2	0,0	0,0	37,2	80,9	5,0
>180	19,7	18,1	0,0	0,0	18,1	19,7	0,0
Total	552,1	609,7	344,3	272,2	199,7	214,2	65,7

* 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	0,1 %	4,3 %	4,6 %	3,8 %
15-35	4,5 %	4,5 %	4,1 %	4,4 %
36-60	0,0 %	4,4 %	3,0 %	3,4 %
61-90	-	4,3 %	4,0 %	4,2 %
91-180	3,8 %	1,8 %	3,7 %	3,1 %
>180	-	4,1 %	3,8 %	4,0 %
Total	1,0 %	4,2 %	4,1 %	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	10 al 14 de noviembre				17 al 21 de noviembre				24 al 28 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	53	100	2681	3168	40	103	2460	2861	9	102	2580	3621
Intragruppo y off-shore***	0	0	2137	980	0	0	1838	979	0	0	2323	1116
Otros	100	53	431	1100	103	40	503	961	102	9	713	880
Total	153	153	5249	5249	144	144	4801	4801	111	111	5617	5617

* 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.