

Fecha de Publicación: 13 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 11 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\$235,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	89,6	26,6	9,7	84,0	16,9	5,6	0,0
15-35	15,3	87,0	84,0	11,0	1,9	3,1	1,2
36-60	0,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,8	0,0
61-90	2,2	1,1	0,0	0,0	1,1	2,2	0,0
91-180	0,0	3,2	2,9	0,0	0,3	0,0	0,0
>180	2,6	7,9	5,0	0,0	2,9	2,6	0,0
Total	110,5	125,8	101,6	95,0	23,0	14,3	1,2

* 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	-	4,3 %	4,3 %	4,3 %
15-35	4,3 %	4,9 %	3,4 %	4,8 %
36-60	-	-	2,7 %	2,7 %
61-90	-	4,3 %	3,6 %	3,8 %
91-180	-	4,0 %	1,5 %	4,0 %
>180	-	4,1 %	3,2 %	3,9 %
Total	4,3 %	4,7 %	4,2 %	4,5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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	102	2766	3167	41	110	2464	2879	9	102	2584	3655
Intragrupo y off-shore***	0	0	2137	1064	0	0	1844	979	0	0	2357	1116
Otros	102	53	430	1101	110	41	515	965	102	9	713	883
Total	154	154	5333	5333	151	151	4822	4822	111	111	5654	5654

* 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.

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.