

Fecha de Publicación: 14 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 12 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\$2218,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	720,8	381,4	245,5	516,1	20,9	89,7	115,0
15-35	411,5	709,2	459,1	218,6	78,6	21,5	171,5
36-60	11,8	14,5	0,0	0,0	4,5	1,8	10,0
61-90	21,9	25,0	0,0	0,0	25,0	21,9	0,0
91-180	24,5	96,2	75,0	0,0	11,2	14,5	10,0
>180	65,1	43,1	20,0	0,0	23,1	65,1	0,0
Total	1255,6	1269,4	799,6	734,7	163,3	214,4	306,5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,7 %	-2,8 %	2,8 %	1,3 %
15-35	3,6 %	4,0 %	4,5 %	4,0 %
36-60	4,4 %	4,7 %	3,6 %	4,4 %
61-90	-	4,2 %	3,9 %	4,1 %
91-180	4,0 %	3,8 %	3,7 %	3,8 %
>180	-	4,1 %	3,7 %	3,8 %
Total	4,1 %	1,9 %	3,3 %	2,8 %

*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

Sector	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**	39	105	3250	3203	46	115	2622	3145	9	103	2686	3845
Intragruppo y off-shore***	0	0	2147	1506	0	0	2049	1059	0	0	2502	1116
Otros	105	39	436	1124	114	46	520	988	103	9	718	946
Total	144	144	5832	5832	160	160	5191	5191	112	112	5907	5907

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.