

Fecha de Publicación: 19 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 14 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\$1088,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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 | 126,2 | 101,8 | 48,5 | 58,7 | 38,3 | 52,5 | 15,0 |
| 15-35 | 411,6 | 242,5 | 157,7 | 243,8 | 34,8 | 117,9 | 50,0 |
| 36-60 | 2,5 | 14,8 | 0,0 | 0,0 | 14,8 | 2,5 | 0,0 |
| 61-90 | 19,3 | 18,6 | 10,0 | 0,0 | 8,6 | 19,3 | 0,0 |
| 91-180 | 56,5 | 26,8 | 0,0 | 10,0 | 16,8 | 36,5 | 10,0 |
| >180 | 47,8 | 95,2 | 90,0 | 10,0 | 5,2 | 37,8 | 0,0 |
| Total | 663,9 | 499,7 | 306,2 | 322,5 | 118,5 | 266,5 | 75,0 |

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

* 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** | 39 | 101 | 3333 | 3214 | 48 | 120 | 2772 | 3267 | 12 | 104 | 2753 | 3962 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2147 | 1585 | 0 | 0 | 2130 | 1132 | 0 | 0 | 2597 | 1116 |
| Otros | 100 | 39 | 447 | 1128 | 120 | 48 | 547 | 1050 | 104 | 12 | 741 | 1013 |
| Total | 139 | 139 | 5927 | 5927 | 168 | 168 | 5449 | 5449 | 116 | 116 | 6091 | 6091 |

* 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.