

Fecha de Publicación: 21 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 19 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\$1558,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	441,9	153,1	71,3	365,8	59,8	54,1	22,0
15-35	326,4	500,2	400,5	157,0	36,7	106,4	63,0
36-60	22,9	23,9	0,0	0,0	3,9	2,9	20,0
61-90	37,3	3,5	0,0	0,0	3,5	37,3	0,0
91-180	46,0	41,8	25,0	0,0	6,8	36,0	10,0
>180	11,0	75,4	58,0	0,0	7,4	1,0	10,0
Total	885,6	797,9	554,8	522,8	118,1	237,8	125,0

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

*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	17 al 21 de noviembre				24 al 28 de noviembre				1 al 5 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	124	3287	3464	15	120	2944	4105	37	63	2623	4266
Intragrupa y off-shore***	0	0	2295	1600	0	0	2671	1152	0	0	2735	768
Otros	124	52	557	1075	120	15	740	1097	63	37	575	899
Total	176	176	6139	6139	135	135	6354	6354	100	100	5933	5933

* 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.