

Fecha de Publicación: 24 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 20 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\$1510,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	314,3	180,8	91,0	205,3	24,5	43,8	65,3
15-35	368,4	416,3	326,8	253,5	12,5	37,9	77,0
36-60	35,3	35,1	0,0	10,0	35,1	25,3	0,0
61-90	42,9	124,6	50,0	30,0	74,6	12,9	0,0
91-180	41,7	32,1	0,0	0,0	32,1	41,7	0,0
>180	16,8	45,0	10,0	15,0	35,0	1,8	0,0
Total	819,3	833,9	477,8	513,8	213,9	163,3	142,3

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

*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	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	122	3396	3468	17	123	3066	4122	37	63	2694	4445
Intragrupa y off-shore***	0	0	2295	1705	0	0	2671	1248	0	0	2846	773
Otros	122	52	560	1080	123	17	756	1123	63	37	578	900
Total	174	174	6252	6252	139	139	6493	6493	101	101	6117	6117

* 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.