

Fecha de Publicación: 25 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 21 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\$1877,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	392,3	230,6	128,3	304,0	57,3	43,3	45,0
15-35	599,9	385,4	349,8	488,0	18,7	94,9	17,0
36-60	41,2	111,3	90,0	0,0	21,3	41,2	0,0
61-90	0,9	38,5	0,0	0,0	38,5	0,9	0,0
91-180	73,7	24,3	0,0	0,0	19,3	68,7	5,0
>180	12,6	33,3	30,0	5,0	3,3	7,6	0,0
Total	1120,7	823,3	598,0	797,0	158,3	256,7	67,0

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

*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	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	121	3396	3468	17	125	3408	4198	37	64	2743	4595
Intragruppo y off-shore***	0	0	2295	1705	0	0	2688	1524	0	0	2957	801
Otros	121	52	561	1080	125	17	780	1155	63	37	607	911
Total	174	174	6253	6253	142	142	6877	6877	101	101	6306	6306

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.