

Fecha de Publicación: 27 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 25 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\$1677,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupos y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	339,4	165,0	66,0	227,0	41,0	54,4	58,0
15-35	325,7	604,9	459,1	176,2	31,8	35,5	114,0
36-60	95,4	104,1	0,0	0,0	104,1	95,4	0,0
61-90	63,6	4,6	0,0	0,0	4,6	63,6	0,0
91-180	69,1	60,0	30,0	0,0	30,0	69,1	0,0
>180	1,5	16,2	15,0	0,0	1,2	1,5	0,0
Total	894,7	954,9	570,1	403,2	212,8	319,5	172,0

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

*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	24 al 28 de noviembre				1 al 5 de diciembre				8 al 12 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	119	3998	4401	40	64	2928	4747	52	78	2447	2405
Intragrupos y off-shore***	0	0	2744	1976	0	0	3023	877	0	0	1405	722
Otros	119	18	809	1176	64	40	632	960	78	52	554	1278
Total	137	137	7552	7552	105	105	6583	6583	130	130	4406	4406

* 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.