

Fecha de Publicación: 28 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 26 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\$1080,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.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	273,4	120,1	6,0	143,0	40,6	56,9	73,5
15-35	198,1	372,8	293,0	80,0	8,8	47,1	71,0
36-60	31,5	37,8	32,0	4,0	5,8	27,5	0,0
61-90	27,6	29,7	10,0	0,0	9,7	17,6	10,0
91-180	1,8	101,9	10,0	0,0	91,9	1,8	0,0
>180	6,1	34,3	20,0	0,0	14,3	6,1	0,0
Total	538,5	696,6	371,0	227,0	171,1	157,0	154,5

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

*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	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**	17	121	4157	4422	50	67	3027	4840	61	78	2483	2487
Intragrupa y off-shore***	0	0	2746	2115	0	0	3028	881	0	0	1483	744
Otros	121	17	809	1175	67	50	667	1001	78	61	554	1289
Total	139	139	7712	7712	118	118	6722	6722	138	138	4520	4520

* 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.