

Fecha de Publicación: 11 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 09 de diciembre 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\$901,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	193,8	186,4	47,7	71,7	48,7	32,1	90,0
15-35	207,7	235,0	139,5	97,8	44,5	58,9	51,0
36-60	59,4	12,6	0,0	0,0	12,6	59,4	0,0
61-90	14,9	29,6	15,0	0,0	4,6	4,9	10,0
91-180	14,9	49,6	32,0	0,0	17,6	14,9	0,0
>180	38,1	15,2	5,0	10,0	5,2	23,1	5,0
Total	528,8	528,4	239,2	179,5	133,2	193,4	156,0

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

*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	8 al 12 de diciembre				15 al 19 de diciembre				22 al 26 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	76	96	3152	3389	25	117	2427	2944	9	90	1262	1614
Intragrupa y off-shore***	0	0	2039	1096	0	0	1713	1056	0	0	1149	899
Otros	96	76	746	1452	117	25	494	634	90	9	259	158
Total	172	172	5937	5937	141	141	4634	4634	99	99	2671	2671

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.