

Fecha de Publicación: 12 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 10 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\$1420,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	306,1	257,0	166,5	204,5	33,0	44,1	57,5
15-35	362,9	400,1	254,6	51,5	18,6	184,4	127,0
36-60	5,8	36,7	0,1	0,0	36,6	5,8	0,0
61-90	38,6	103,1	0,7	0,0	92,5	28,6	10,0
91-180	23,6	35,7	20,0	0,0	15,7	23,6	0,0
>180	31,1	24,0	0,0	4,5	14,0	16,6	10,0
Total	768,2	856,6	441,8	260,5	210,3	303,1	204,5

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

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	75	113	3350	3444	28	127	2535	3107	9	83	1298	1662
Intragruppo y off-shore***	0	0	2051	1252	0	0	1859	1119	0	0	1165	903
Otros	113	75	753	1458	127	28	501	669	83	9	260	159
Total	188	188	6153	6153	155	155	4895	4895	92	92	2723	2723

* 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.