

Fecha de Publicación: 15 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 11 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\$1556,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	225,5	123,3	55,6	147,0	29,3	40,0	38,5
15-35	402,1	416,2	239,2	66,5	42,0	200,6	135,0
36-60	164,1	9,9	0,0	0,0	9,9	164,1	0,0
61-90	33,9	79,8	0,5	0,0	49,3	3,9	30,0
91-180	83,9	180,2	105,0	10,0	75,2	73,9	0,0
>180	32,2	9,3	1,2	20,0	8,1	12,2	0,0
Total	941,6	818,7	401,5	243,5	213,7	494,6	203,5

* 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	1,8 %	3,6 %	2,2 %	2,5 %
15-35	1,5 %	3,5 %	3,1 %	2,9 %
36-60	-	5,2 %	3,2 %	3,3 %
61-90	2,1 %	4,1 %	2,7 %	3,3 %
91-180	-	3,4 %	3,1 %	3,3 %
>180	-	4,7 %	2,7 %	3,6 %
Total	1,6 %	3,6 %	2,8 %	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	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**	77	116	3371	3470	32	120	2731	3210	9	85	1301	1664
Intragrupa y off-shore***	0	0	2069	1267	0	0	1896	1251	0	0	1165	903
Otros	116	77	753	1456	120	32	536	703	85	9	263	162
Total	193	193	6193	6193	152	152	5163	5163	94	94	2729	2729

* 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.