

Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 12 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\$968,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	96,8	123,7	40,0	29,0	44,7	28,8	39,0
15-35	263,0	257,9	145,8	142,3	37,6	46,2	74,5
36-60	155,7	28,5	0,0	15,5	13,0	124,7	15,5
61-90	29,9	57,9	10,0	2,5	27,9	7,4	20,0
91-180	10,1	26,5	0,0	0,0	26,5	10,1	0,0
>180	28,3	39,0	25,0	10,0	14,0	18,3	0,0
Total	583,8	533,4	220,8	199,3	163,7	235,6	149,0

* 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	1,3 %	3,2 %	1,9 %	2,4 %
15-35	2,2 %	3,1 %	2,2 %	2,6 %
36-60	3,0 %	3,9 %	2,9 %	3,0 %
61-90	2,7 %	3,3 %	2,4 %	3,0 %
91-180	-	3,8 %	2,5 %	3,4 %
>180	-	3,4 %	2,6 %	3,0 %
Total	2,1 %	3,2 %	2,4 %	2,7 %

*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	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	115	3372	3493	36	124	2785	3288	10	86	1339	1705
Intragrupo y off-shore***	0	0	2069	1267	0	0	1926	1277	0	0	1175	906
Otros	115	77	775	1456	124	36	572	719	86	10	266	169
Total	191	191	6216	6216	160	160	5283	5283	96	96	2780	2780

* 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.