

Fecha de Publicación: 18 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 16 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\$1017,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,4%.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	105,6	146,3	93,0	61,5	20,3	11,1	33,0
15-35	375,9	406,6	217,5	119,5	12,6	79,9	176,5
36-60	90,3	63,5	0,0	0,0	20,5	47,3	43,0
61-90	16,8	2,9	0,0	10,0	2,9	6,8	0,0
91-180	6,4	18,5	0,0	0,0	18,5	6,4	0,0
>180	29,2	7,6	0,0	0,0	7,6	29,2	0,0
Total	624,2	645,4	310,5	191,0	82,4	180,7	252,5

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

*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	15 al 19 de diciembre				22 al 26 de diciembre				29 de dic. al 2 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	131	3008	3454	10	88	1430	1776	7	74	1289	1885
Intragrupa y off-shore***	0	0	2023	1425	0	0	1209	924	0	0	1304	853
Otros	131	37	599	750	88	10	283	223	74	7	248	102
Total	168	168	5629	5629	98	98	2922	2922	81	81	2840	2840

* 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.