

Fecha de Publicación: 19 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 17 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\$1437,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,2%.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	372,6	207,3	143,0	298,1	22,3	32,6	42,0
15-35	247,7	279,5	177,8	157,0	48,1	37,2	53,5
36-60	3,3	189,9	134,0	0,0	55,9	3,3	0,0
61-90	86,7	34,3	0,0	0,0	14,3	66,7	20,0
91-180	30,9	16,3	0,0	0,0	16,3	30,9	0,0
>180	46,1	45,8	20,0	6,0	17,8	32,1	8,0
Total	787,4	773,2	474,8	461,1	174,8	202,8	123,5

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

*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	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**	39	138	3226	3546	11	89	1502	1912	7	75	1385	1886
Intragrupa y off-shore***	0	0	2061	1587	0	0	1314	965	0	0	1304	947
Otros	138	39	629	782	89	11	296	235	75	7	248	104
Total	176	176	5915	5915	100	100	3112	3112	81	81	2936	2936

* 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.