

Fecha de Publicación: 22 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 18 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\$1730,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,2%.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	425,9	263,8	155,8	247,0	16,3	87,2	91,7
15-35	302,8	637,9	323,8	127,0	189,4	51,1	124,7
36-60	17,0	20,4	0,0	0,0	20,4	17,0	0,0
61-90	56,2	26,3	0,0	0,1	26,3	56,1	0,0
91-180	54,3	50,5	20,0	0,2	30,5	54,0	0,0
>180	27,6	74,1	10,0	10,0	54,1	7,6	10,0
Total	883,8	1073,0	509,6	384,4	337,1	273,1	226,4

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

*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

Sectores	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	C	V						
Sector Financiero**	37	137	3258	3573	13	91	1705	2079	7	67	1579	1967								
Intragrupa y off-shore***	0	0	2061	1614	0	0	1460	1064	0	0	1314	1069								
Otros	137	37	655	786	91	13	296	319	67	7	248	106								
Total	174	174	5974	5974	105	105	3461	3461	73	73	3142	3142								

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.