

Fecha de Publicación: 23 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 19 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\$1138,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,4%.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	121,9	121,7	72,0	51,0	5,7	26,9	44,0
15-35	320,8	353,1	134,7	143,0	75,4	34,8	143,0
36-60	33,6	30,7	0,0	2,9	30,7	30,7	0,0
61-90	123,4	176,8	66,6	10,0	35,2	38,4	75,0
91-180	48,7	22,2	0,0	0,0	22,2	48,7	0,0
>180	34,0	23,3	10,0	0,0	3,3	24,0	10,0
Total	682,4	727,9	283,3	206,9	172,6	203,5	272,0

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

*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	C	V						
Sector Financiero**	37	137	3257	3579	13	96	1794	2186	7	68	1612	1967								
Intragrupa y off-shore***	0	0	2061	1614	0	0	1528	1095	0	0	1318	1089								
Otros	137	37	662	786	96	13	292	333	68	7	244	119								
Total	174	174	5980	5980	109	109	3614	3614	75	75	3174	3174								

* 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.