

Fecha de Publicación: 24 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 22 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\$657,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	125,6	72,6	70,5	75,0	2,1	50,6	0,0
15-35	107,1	207,3	139,5	66,0	43,8	17,1	24,0
36-60	21,4	25,1	0,0	0,0	15,1	11,4	10,0
61-90	2,4	29,1	0,0	0,0	29,1	2,4	0,0
91-180	29,8	35,7	0,0	0,0	35,7	29,8	0,0
>180	15,0	20,6	0,0	10,0	20,6	5,0	0,0
Total	301,3	390,4	210,0	151,0	146,4	116,3	34,0

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

*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	22 al 26 de diciembre				29 de dic. al 2 de enero				5 al 9 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	100	1859	2235	7	77	1673	1987	8	81	1657	2690
Intragruppo y off-shore***	0	0	1569	1156	0	0	1348	1103	0	0	1749	494
Otros	100	13	300	337	77	7	235	166	81	8	404	627
Total	113	113	3728	3728	84	84	3255	3255	89	89	3811	3811

* 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.