

Fecha de Publicación: 26 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 23 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\$910,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,9%.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	233,0	70,5	16,0	105,8	17,5	90,2	37,0
15-35	142,6	441,8	361,9	15,0	4,9	52,6	75,0
36-60	43,8	41,2	17,0	0,0	7,2	26,8	17,0
61-90	4,0	2,9	0,0	0,0	2,9	4,0	0,0
91-180	22,1	10,5	0,0	0,0	10,5	22,1	0,0
>180	11,8	20,4	15,0	0,0	0,4	6,8	5,0
Total	457,3	587,3	409,9	120,8	43,4	202,6	134,0

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

*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	119	1941	2290	7	61	1755	1997	8	82	1737	2778
Intragrupa y off-shore***	0	0	1575	1184	0	0	1348	1180	0	0	1796	494
Otros	119	13	339	381	61	7	245	170	82	8	409	670
Total	132	132	3855	3855	68	68	3347	3347	90	90	3941	3941

* 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.