

Fecha de Publicación: 29 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 24 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\$305,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	83,7	12,2	0,0	77,1	12,2	6,6	0,0
15-35	35,5	137,1	124,5	10,0	12,6	25,5	0,0
36-60	0,8	1,7	0,0	0,0	1,7	0,8	0,0
61-90	1,2	7,7	0,0	0,0	7,7	1,2	0,0
91-180	0,6	12,7	0,0	0,0	12,7	0,6	0,0
>180	2,1	10,0	10,0	0,0	0,0	2,1	0,0
Total	124,0	181,5	134,5	87,1	47,0	36,8	0,0

* 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	-	3,9 %	3,1 %	3,1 %
15-35	-	3,4 %	2,7 %	3,2 %
36-60	-	4,4 %	0,2 %	3,1 %
61-90	-	-15,7 %	1,4 %	-13,4 %
91-180	-	4,3 %	2,1 %	4,2 %
>180	-	3,4 %	2,3 %	3,2 %
Total	-	2,5 %	2,9 %	2,7 %

*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	128	2021	2294	7	66	1757	1996	9	80	1749	2790
Intragrupa y off-shore***	0	0	1575	1257	0	0	1348	1180	0	0	1808	497
Otros	128	13	343	387	66	7	244	172	80	9	409	678
Total	141	141	3938	3938	73	73	3348	3348	89	89	3965	3965

* 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.