

Fecha de Publicación: 30 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 26 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\$377,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	122,7	56,5	10,0	70,5	6,5	12,2	40,0
15-35	54,8	171,9	144,0	11,0	9,9	25,8	18,0
36-60	3,2	3,6	0,0	0,0	3,6	3,2	0,0
61-90	7,1	1,0	0,0	0,0	1,0	7,1	0,0
91-180	4,1	1,9	0,0	0,0	1,9	4,1	0,0
>180	2,2	6,6	0,0	0,0	6,6	2,2	0,0
Total	194,0	241,4	154,0	81,5	29,4	54,5	58,0

* 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	1,8 %	10,3 %	2,2 %	2,1 %
15-35	3,5 %	3,3 %	2,4 %	3,1 %
36-60	-	5,8 %	-21,0 %	-6,8 %
61-90	-	3,6 %	2,7 %	2,8 %
91-180	-	4,4 %	2,2 %	2,9 %
>180	-	3,7 %	-6,7 %	1,1 %
Total	2,3 %	3,5 %	1,4 %	2,4 %

*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

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**	11	107	2023	2327	6	73	1810	2031	10	78	1818	2812
Intragrupa y off-shore***	0	0	1575	1257	0	0	1358	1232	0	0	1808	516
Otros	107	11	376	390	73	6	269	173	78	10	391	689
Total	118	118	3974	3974	78	78	3436	3436	89	89	4018	4018

* 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.