

Fecha de Publicación: 2 de enero de 2015

Fecha de Información: 29 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\$495,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	94,5	22,0	16,5	58,3	5,6	36,3	0,0
15-35	138,9	217,2	147,3	14,0	2,9	57,9	67,0
36-60	20,6	11,9	0,0	0,0	11,9	20,6	0,0
61-90	13,0	11,9	0,0	0,0	11,9	13,0	0,0
91-180	4,1	18,3	0,0	0,0	18,3	4,1	0,0
>180	4,0	6,2	5,0	0,0	1,2	4,0	0,0
Total	275,0	287,5	168,8	72,3	51,8	135,8	67,0

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

*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	29 de dic. al 2 de enero				5 al 9 de enero				12 al 16 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	5	82	1872	2045	25	79	1836	2817	37	103	2488	2601
Intragrupa y off-shore***	0	0	1371	1286	0	0	1811	521	0	0	1561	510
Otros	82	5	270	182	79	25	392	702	103	37	499	1437
Total	87	87	3513	3513	104	104	4039	4039	141	141	4548	4548

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.