

Fecha de Publicación: 2 de enero de 2015

Fecha de Información: 30 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\$502,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	36,7	9,6	0,0	4,0	9,6	32,7	0,0
15-35	177,5	208,0	30,1	71,5	120,9	49,0	57,0
36-60	6,8	15,6	0,0	0,0	15,6	6,8	0,0
61-90	48,8	6,2	0,0	0,0	6,2	48,8	0,0
91-180	16,3	37,0	0,0	0,0	25,0	4,3	12,0
>180	8,4	0,2	0,0	0,0	0,2	8,4	0,0
Total	294,5	276,7	30,1	75,5	177,6	150,0	69,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	4,6 %	1,0 %	1,8 %
15-35	2,8 %	4,9 %	0,9 %	3,0 %
36-60	-	4,3 %	1,3 %	3,4 %
61-90	-	3,8 %	1,8 %	2,0 %
91-180	2,9 %	4,5 %	2,4 %	3,8 %
>180	-	4,6 %	2,5 %	2,6 %
Total	2,8 %	4,7 %	1,2 %	2,8 %

*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

Sector	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	1873	2046	26	80	1869	2826	46	122	2513	2606
Intragruppo y off-shore***	0	0	1371	1286	0	0	1811	525	0	0	1563	516
Otros	82	5	270	182	80	26	402	731	122	46	503	1457
Total	87	87	3514	3514	106	106	4082	4082	168	168	4579	4579

* 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 intragruppo.