

Fecha de Publicación: 1 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 27 de noviembre 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\$210,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	30,1	26,8	0,0	0,0	21,8	25,1	5,0
15-35	28,9	41,3	29,7	8,0	6,6	15,9	5,0
36-60	7,9	48,7	0,0	0,0	48,7	7,9	0,0
61-90	3,4	7,1	0,0	0,0	7,1	3,4	0,0
91-180	0,9	12,8	0,0	0,0	12,8	0,9	0,0
>180	3,2	9,4	0,0	0,0	9,4	3,2	0,0
Total	74,4	146,3	29,7	8,0	106,6	56,4	10,0

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

*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	Vencimientos de Forwards											
	24 al 28 de noviembre				1 al 5 de diciembre				8 al 12 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	116	4160	4430	51	68	3048	4854	67	83	2489	2496
Intragrupa y off-shore***	0	0	2746	2115	0	0	3028	881	0	0	1483	744
Otros	116	17	817	1178	68	51	681	1022	83	67	559	1290
Total	133	133	7723	7723	119	119	6757	6757	150	150	4530	4530

* 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.