

Fecha de Publicación: 2 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 28 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\$1576,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupos y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	130,8	178,8	108,0	36,0	35,8	59,8	35,0
15-35	451,0	591,9	340,5	256,5	114,4	57,5	137,0
36-60	73,6	13,5	0,0	0,0	13,5	73,6	0,0
61-90	32,2	130,2	85,0	0,0	35,2	22,2	10,0
91-180	29,0	19,4	0,0	0,0	19,4	29,0	0,0
>180	36,9	71,3	60,0	0,0	11,3	36,9	0,0
Total	753,5	1005,1	593,5	292,5	229,6	279,0	182,0

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

*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	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	110	4160	4439	51	70	3131	4917	70	88	2533	2605
Intragrupos y off-shore***	0	0	2746	2115	0	0	3044	901	0	0	1575	760
Otros	110	17	827	1178	70	51	708	1065	88	70	560	1303
Total	127	127	7732	7732	122	122	6882	6882	158	158	4668	4668

* 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.