

Fecha de Publicación: 3 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 01 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\$806,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.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	80,3	136,2	78,3	28,0	38,9	33,3	19,0
15-35	185,2	136,7	93,8	161,0	30,9	12,2	12,0
36-60	135,5	52,2	0,0	21,8	12,2	73,7	40,0
61-90	41,4	75,0	0,0	0,0	35,0	1,4	40,0
91-180	23,4	22,4	0,0	0,0	21,4	22,4	1,0
>180	18,4	11,5	0,0	9,3	11,5	9,1	0,0
Total	484,2	434,1	172,1	220,1	150,0	152,1	112,0

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

*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	1 al 5 de diciembre						8 al 12 de diciembre				15 al 19 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V		
Sector Financiero**	60	73	3172	4966	71	88	2552	2665	24	109	1974	2397		
Intragrupa y off-shore***	0	0	3065	924	0	0	1612	760	0	0	1525	916		
Otros	73	60	729	1076	88	71	576	1315	109	24	390	576		
Total	133	133	6966	6966	159	159	4740	4740	133	133	3889	3889		

* 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.