

Fecha de Publicación: 4 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 02 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\$1679,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.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	387,9	263,6	149,2	273,1	69,7	70,1	44,7
15-35	237,4	558,7	442,5	138,0	31,9	15,1	84,3
36-60	98,2	45,1	23,0	0,0	22,1	98,2	0,0
61-90	75,4	45,1	0,0	15,0	45,1	60,4	0,0
91-180	47,0	3,6	0,0	0,0	3,6	47,0	0,0
>180	36,7	9,8	2,2	20,0	7,6	16,7	0,0
Total	882,5	925,9	616,9	446,1	180,0	307,4	129,0

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

*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	74	3474	5088	76	92	2613	2771	24	115	2037	2513
Intragrupa y off-shore***	0	0	3131	1177	0	0	1686	775	0	0	1583	921
Otros	74	60	775	1115	92	76	592	1344	115	24	391	576
Total	134	134	7380	7380	168	168	4890	4890	139	139	4010	4010

* 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.