

Fecha de Publicación: 5 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 03 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\$2242,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	691,4	311,8	154,0	545,6	34,3	22,4	123,5
15-35	367,2	498,0	384,6	257,0	40,4	37,2	73,0
36-60	52,6	176,1	154,8	0,0	21,3	52,6	0,0
61-90	36,7	130,3	117,5	0,0	12,8	36,7	0,0
91-180	2,9	72,8	50,0	0,0	22,8	2,9	0,0
>180	48,2	61,4	35,0	35,0	16,4	3,2	10,0
Total	1198,9	1250,3	895,9	837,6	148,0	154,9	206,5

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

*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**	59	72	3869	5196	76	94	2744	2955	24	116	2220	2643
Intragrupos y off-shore***	0	0	3161	1561	0	0	1805	856	0	0	1588	1001
Otros	72	59	853	1126	94	76	617	1354	116	24	431	596
Total	131	131	7884	7884	170	170	5165	5165	140	140	4239	4239

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.