

Fecha de Publicación: 9 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 04 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\$2110,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	579,4	367,0	197,8	436,8	74,3	47,7	95,0
15-35	139,4	687,4	591,0	53,8	36,4	25,7	60,0
36-60	80,7	52,3	15,0	0,0	12,3	55,7	25,0
61-90	1,5	23,0	7,0	0,0	16,0	1,5	0,0
91-180	74,0	128,9	30,0	0,5	98,9	73,5	0,0
>180	52,5	104,2	10,1	40,0	94,1	12,5	0,0
Total	927,4	1362,8	850,9	531,0	331,9	216,4	180,0

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

*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	71	4309	5403	77	94	2866	3152	24	121	2329	2788
Intragrupa y off-shore***	0	0	3254	1975	0	0	1956	935	0	0	1649	1035
Otros	71	59	947	1132	94	77	653	1387	121	24	449	605
Total	130	130	8509	8509	171	171	5475	5475	145	145	4427	4427

* 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.