

Fecha de Publicación: 10 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 05 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\$1237,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	185,4	202,1	104,2	109,7	78,9	56,7	19,0
15-35	128,9	393,0	320,5	74,8	31,5	13,2	41,0
36-60	118,6	49,8	0,0	0,0	39,8	108,6	10,0
61-90	39,9	39,6	0,0	20,0	39,6	19,9	0,0
91-180	46,2	12,7	0,0	0,0	12,7	46,2	0,0
>180	39,2	52,1	0,0	0,0	52,1	39,2	0,0
Total	558,2	749,4	424,7	204,5	254,7	283,7	70,0

* 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 %	3,3 %	2,1 %	2,7 %
15-35	10,7 %	3,1 %	3,0 %	3,7 %
36-60	3,2 %	3,3 %	2,8 %	3,0 %
61-90	-	3,3 %	2,9 %	3,1 %
91-180	-	2,9 %	2,9 %	2,9 %
>180	-	3,4 %	3,0 %	3,3 %
Total	7,6 %	3,2 %	2,6 %	3,2 %

*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	69	4309	5404	82	93	3023	3269	24	113	2357	2889
Intragrupa y off-shore***	0	0	3254	1975	0	0	2005	1045	0	0	1704	1035
Otros	69	59	948	1132	93	82	710	1424	113	24	488	625
Total	129	129	8511	8511	175	175	5738	5738	137	137	4549	4549

* 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.