

Fecha de Publicación: 8 de enero de 2015

Fecha de Información: 06 de enero de 2015 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\$1436,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 425,6 | 144,9 | 73,6 | 357,9 | 48,3 | 44,7 | 23,0 |
| 15-35 | 182,8 | 461,6 | 371,7 | 61,3 | 30,9 | 62,5 | 59,0 |
| 36-60 | 33,0 | 28,3 | 0,0 | 0,0 | 8,3 | 13,0 | 20,0 |
| 61-90 | 11,3 | 13,2 | 0,0 | 0,0 | 3,2 | 1,3 | 10,0 |
| 91-180 | 5,8 | 3,3 | 0,0 | 0,0 | 3,3 | 5,8 | 0,0 |
| >180 | 111,8 | 134,0 | 106,0 | 100,0 | 21,0 | 4,8 | 7,0 |
| Total | 770,4 | 785,2 | 551,3 | 519,2 | 114,9 | 132,2 | 119,0 |

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

*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 | 5 al 9 de enero | | | | 12 al 16 de enero | | | | 19 al 23 de enero | | | |
|----------------------------------|-----------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 27 | 81 | 2498 | 3002 | 56 | 128 | 2605 | 2788 | 11 | 67 | 1840 | 2379 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1912 | 1070 | 0 | 0 | 1632 | 531 | 0 | 0 | 1085 | 398 |
| Otros | 81 | 27 | 428 | 767 | 128 | 56 | 601 | 1519 | 67 | 11 | 737 | 885 |
| Total | 108 | 108 | 4838 | 4838 | 184 | 184 | 4837 | 4837 | 78 | 78 | 3662 | 3662 |

* 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.