

Fecha de Publicación: 13 de enero de 2015

Fecha de Información: 08 de enero de 2015¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1766,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	469,2	308,5	97,0	205,0	56,5	109,2	155,0
15-35	485,5	510,6	356,9	138,0	24,7	218,5	129,0
36-60	46,1	29,4	10,0	0,0	19,4	46,1	0,0
61-90	2,9	55,1	20,0	0,0	35,1	2,9	0,0
91-180	39,4	28,7	0,0	10,0	18,7	19,4	10,0
>180	57,6	67,2	15,0	15,0	12,2	2,6	40,0
Total	1100,6	999,6	498,9	368,0	166,7	398,6	334,0

* 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	1,8 %	2,8 %	1,6 %	2,0 %
15-35	3,0 %	3,3 %	2,9 %	3,1 %
36-60	-	3,9 %	3,0 %	3,3 %
61-90	-	3,6 %	2,6 %	3,5 %
91-180	3,5 %	3,6 %	2,7 %	3,2 %
>180	3,4 %	3,3 %	-1,1 %	3,2 %
Total	2,5 %	3,2 %	2,3 %	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	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	C	V	C	V	C	V						
Sector Financiero**	28	86	2843	3168	64	133	2940	3106	13	71	2008	2539												
Intragrupa y off-shore***	0	0	1981	1319	0	0	1733	640	0	0	1161	428												
Otros	86	28	439	776	133	64	663	1590	71	13	756	957												
Total	114	114	5263	5263	197	197	5336	5336	85	85	3925	3925												

* 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.