

Fecha de Publicación: 14 de enero de 2015

Fecha de Información: 09 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 2,9%.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 | 193,3 | 168,5 | 51,5 | 96,9 | 53,0 | 32,3 | 64,0 |
| 15-35 | 346,9 | 548,6 | 440,5 | 148,0 | 13,0 | 103,8 | 95,1 |
| 36-60 | 2,7 | 9,6 | 0,0 | 0,0 | 9,6 | 2,7 | 0,0 |
| 61-90 | 14,5 | 29,1 | 20,1 | 0,6 | 9,1 | 13,9 | 0,0 |
| 91-180 | 56,6 | 44,5 | 15,0 | 0,0 | 9,4 | 36,5 | 20,1 |
| >180 | 45,2 | 162,1 | 45,1 | 35,0 | 111,2 | 4,4 | 5,8 |
| Total | 659,1 | 962,5 | 572,2 | 280,5 | 205,4 | 193,6 | 184,9 |

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

*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** | 28 | 85 | 2843 | 3169 | 66 | 135 | 3110 | 3199 | 14 | 71 | 2029 | 2595 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1981 | 1319 | 0 | 0 | 1745 | 732 | 0 | 0 | 1201 | 433 |
| Otros | 85 | 28 | 440 | 776 | 135 | 66 | 680 | 1604 | 71 | 14 | 772 | 974 |
| Total | 113 | 113 | 5264 | 5264 | 201 | 201 | 5534 | 5534 | 85 | 85 | 4002 | 4002 |

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