

Fecha de Publicación: 15 de enero de 2015

Fecha de Información: 13 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\$1253,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	159,5	93,1	45,5	60,1	16,6	68,4	31,0
15-35	310,1	637,1	417,8	58,5	113,3	145,6	106,0
36-60	34,8	11,6	0,0	10,0	6,6	19,8	5,0
61-90	9,5	50,4	4,0	0,0	46,4	9,5	0,0
91-180	12,0	52,5	32,0	0,0	20,5	12,0	0,0
>180	15,1	9,7	0,0	0,0	9,7	15,1	0,0
Total	541,0	854,4	499,3	128,6	213,1	270,4	142,0

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

*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	12 al 16 de enero				19 al 23 de enero				26 al 30 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	66	134	3206	3270	18	74	2052	2611	13	87	999	1435
Intragrupa y off-shore***	0	0	1775	792	0	0	1216	433	0	0	768	198
Otros	134	66	690	1609	74	18	773	997	87	13	526	660
Total	200	200	5671	5671	92	92	4041	4041	100	100	2293	2293

* 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.