

Fecha de Publicación: 16 de enero de 2015

Fecha de Información: 14 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\$2391,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.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	534,1	254,9	221,4	400,0	18,5	119,1	15,0
15-35	616,7	891,1	663,0	280,5	43,1	151,2	185,0
36-60	26,4	83,7	73,0	0,0	7,8	23,4	3,0
61-90	20,3	63,7	40,0	0,0	23,7	20,3	0,0
91-180	11,3	14,5	0,0	0,0	14,5	11,3	0,0
>180	53,1	24,2	0,0	30,0	24,2	23,1	0,0
Total	1261,9	1332,2	997,3	710,5	131,8	348,4	203,0

* 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	41,2 %	4,1 %	3,3 %	4,5 %
15-35	4,0 %	4,4 %	3,3 %	4,0 %
36-60	4,1 %	4,0 %	3,2 %	3,8 %
61-90	-	3,9 %	3,4 %	3,8 %
91-180	-	3,9 %	3,1 %	3,6 %
>180	-	3,7 %	3,2 %	3,5 %
Total	6,7 %	4,2 %	3,3 %	4,1 %

*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

Sectores	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**	67	137	3601	3388	23	77	2104	2625	13	90	1099	1558
Intragrupa y off-shore***	0	0	1876	1169	0	0	1217	456	0	0	887	198
Otros	137	67	691	1611	77	23	786	1026	89	13	531	761
Total	203	203	6168	6168	99	99	4106	4106	103	103	2517	2517

* 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.