

Fecha de Publicación: 20 de enero de 2015

Fecha de Información: 16 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\$996,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	245,5	192,6	67,4	139,0	35,1	16,5	90,0
15-35	270,9	311,4	175,3	125,5	44,6	53,9	91,5
36-60	22,6	35,0	0,0	0,0	35,0	22,6	0,0
61-90	3,2	16,8	0,0	0,0	16,8	3,2	0,0
91-180	2,9	39,4	0,2	0,0	39,2	2,9	0,0
>180	15,1	37,9	0,0	0,0	22,9	0,1	15,0
Total	560,1	632,9	242,9	264,5	193,5	99,1	196,5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-3,4 %	4,0 %	-0,5 %	0,1 %
15-35	1,3 %	5,1 %	3,4 %	3,6 %
36-60	-	4,7 %	3,6 %	4,3 %
61-90	-	4,2 %	3,9 %	4,2 %
91-180	-	4,2 %	3,5 %	4,2 %
>180	3,6 %	4,1 %	3,8 %	3,9 %
Total	-0,7 %	4,6 %	1,8 %	2,4 %

*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**	65	133	3761	3397	25	86	2341	2785	14	94	1142	1665
Intragruppo y off-shore***	0	0	1881	1321	0	0	1285	584	0	0	961	218
Otros	133	65	696	1619	86	25	804	1060	94	14	546	766
Total	198	198	6337	6337	111	111	4429	4429	108	108	2649	2649

* 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 intragruppo.