

Fecha de Publicación: 21 de enero de 2015

Fecha de Información: 19 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\$310,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	85,7	78,5	21,5	20,0	10,0	18,7	47,0
15-35	88,8	110,1	45,0	40,5	18,1	1,3	47,0
36-60	11,5	3,4	0,0	0,0	3,4	11,5	0,0
61-90	0,0	6,2	0,0	0,0	6,2	0,0	0,0
91-180	0,2	17,6	0,0	0,0	17,6	0,2	0,0
>180	1,1	0,9	0,0	0,0	0,9	1,1	0,0
Total	187,3	216,7	66,5	60,5	56,2	32,8	94,0

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

*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

Sectores	19 al 23 de enero				26 al 30 de enero				2 al 6 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	87	2416	2843	14	95	1153	1686	4	70	1814	2361
Intragrupo y off-shore***	0	0	1286	604	0	0	981	218	0	0	1287	415
Otros	87	25	812	1068	95	14	546	777	70	4	430	755
Total	112	112	4514	4514	109	109	2680	2680	74	74	3531	3531

* 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.