

Fecha de Publicación: 23 de enero de 2015

Fecha de Información: 21 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\$1744,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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 | 589,6 | 200,5 | 100,3 | 463,1 | 58,7 | 85,0 | 41,5 |
| 15-35 | 298,2 | 419,3 | 316,7 | 209,5 | 58,1 | 44,2 | 44,5 |
| 36-60 | 8,1 | 58,1 | 38,1 | 0,0 | 20,0 | 8,1 | 0,0 |
| 61-90 | 7,4 | 37,5 | 0,0 | 0,0 | 37,5 | 7,4 | 0,0 |
| 91-180 | 1,1 | 102,2 | 0,0 | 0,0 | 102,2 | 1,1 | 0,0 |
| >180 | 23,7 | 84,9 | 75,0 | 10,0 | 9,9 | 13,7 | 0,0 |
| Total | 928,0 | 902,6 | 530,1 | 682,6 | 286,5 | 159,4 | 86,0 |

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

*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 | 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** | 31 | 88 | 2944 | 2897 | 22 | 99 | 1291 | 1884 | 4 | 74 | 2003 | 2462 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1321 | 1102 | 0 | 0 | 1115 | 331 | 0 | 0 | 1309 | 472 |
| Otros | 88 | 31 | 820 | 1086 | 99 | 22 | 601 | 792 | 74 | 4 | 459 | 837 |
| Total | 120 | 120 | 5086 | 5086 | 121 | 121 | 3007 | 3007 | 78 | 78 | 3771 | 3771 |

* 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.