

Fecha de Publicación: 28 de enero de 2015

Fecha de Información: 26 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\$743,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	168,9	127,5	51,0	88,0	31,5	35,9	45,0
15-35	77,8	315,9	232,6	30,0	38,3	2,8	45,0
36-60	46,0	25,2	3,8	0,0	21,4	46,0	0,0
61-90	2,7	32,6	25,0	0,0	7,6	2,7	0,0
91-180	3,5	21,5	0,0	0,0	21,5	3,5	0,0
>180	11,4	0,8	0,0	10,0	0,8	1,4	0,0
Total	310,3	523,4	312,5	128,0	121,0	92,3	90,0

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

*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

Sectores	26 al 30 de enero				2 al 6 de febrero				9 al 13 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	110	1725	2252	6	73	2124	2695	12	74	2121	3106
Intragruppo y off-shore***	0	0	1326	548	0	0	1457	493	0	0	2051	705
Otros	110	22	620	871	73	6	486	879	74	12	464	825
Total	132	132	3671	3671	79	79	4067	4067	86	86	4637	4637

* 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.