

Fecha de Publicación: 3 de febrero de 2015

Fecha de Información: 30 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\$1301,8 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 | 110,7 | 87,6 | 29,0 | 63,5 | 33,5 | 22,1 | 25,2 |
| 15-35 | 411,2 | 648,0 | 403,7 | 92,0 | 80,3 | 155,2 | 164,0 |
| 36-60 | 23,3 | 19,4 | 1,7 | 0,0 | 4,7 | 10,3 | 13,0 |
| 61-90 | 16,4 | 20,8 | 5,0 | 0,0 | 15,8 | 16,4 | 0,0 |
| 91-180 | 41,5 | 17,3 | 0,0 | 0,0 | 17,3 | 41,5 | 0,0 |
| >180 | 61,2 | 46,6 | 40,0 | 10,0 | 6,6 | 51,2 | 0,0 |
| Total | 664,3 | 839,7 | 479,4 | 165,5 | 158,1 | 296,6 | 202,2 |

* 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 | 0,0 % | 2,9 % | 1,9 % | 2,0 % |
| 15-35 | 0,4 % | 4,1 % | 3,7 % | 3,2 % |
| 36-60 | 3,6 % | 2,5 % | 2,7 % | 3,1 % |
| 61-90 | - | 3,9 % | 2,8 % | 3,4 % |
| 91-180 | - | 4,0 % | 3,0 % | 3,3 % |
| >180 | - | 3,3 % | 3,0 % | 3,1 % |
| Total | 0,6 % | 3,9 % | 3,2 % | 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 | 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** | 16 | 102 | 2151 | 2312 | 16 | 77 | 2365 | 3015 | 39 | 77 | 2444 | 3554 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1331 | 936 | 0 | 0 | 1589 | 605 | 0 | 0 | 2215 | 783 |
| Otros | 101 | 16 | 649 | 882 | 77 | 16 | 587 | 922 | 77 | 39 | 588 | 911 |
| Total | 118 | 118 | 4130 | 4130 | 93 | 93 | 4542 | 4542 | 116 | 116 | 5248 | 5248 |

* 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 intragruppo.