

Fecha de Publicación: 7 de enero de 2015

Fecha de Información: 05 de enero de 2015¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$851,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	277,7	162,4	67,3	172,0	55,1	65,7	40,0
15-35	97,7	265,3	255,0	39,0	5,3	53,7	5,0
36-60	4,5	13,7	0,0	0,0	13,7	4,5	0,0
61-90	14,5	2,1	0,0	0,0	2,1	14,5	0,0
91-180	42,2	6,1	0,0	0,0	6,1	42,2	0,0
>180	5,6	4,6	0,0	0,0	4,6	5,6	0,0
Total	442,2	454,3	322,3	211,0	87,1	186,2	45,0

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

*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	5 al 9 de enero				12 al 16 de enero				19 al 23 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	83	2127	2917	51	126	2558	2728	10	67	1836	2293
Intragrupo y off-shore***	0	0	1861	727	0	0	1610	516	0	0	1005	398
Otros	83	27	403	747	125	51	578	1502	67	10	731	881
Total	111	111	4391	4391	177	177	4746	4746	77	77	3573	3573

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.