

Fecha de Publicación: 4 de febrero de 2015

Fecha de Información: 02 de febrero 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\$1158,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	232,0	159,6	85,0	114,8	45,6	88,2	29,0
15-35	241,9	389,8	291,2	49,5	5,6	99,4	93,0
36-60	13,5	52,2	0,0	0,0	52,2	13,5	0,0
61-90	1,4	13,9	0,0	0,0	13,9	1,4	0,0
91-180	24,3	6,4	0,0	0,0	6,4	24,3	0,0
>180	94,2	91,3	0,0	46,0	51,3	8,2	40,0
Total	607,2	713,2	376,2	210,3	175,0	234,9	162,0

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

*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	2 al 6 de febrero				9 al 13 de febrero				16 al 20 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	74	2443	3140	39	81	2598	3588	26	94	2468	2163
Intragrupa y off-shore***	0	0	1656	630	0	0	2233	873	0	0	1349	850
Otros	74	16	616	946	81	39	604	975	94	26	255	1058
Total	90	90	4716	4716	120	120	5436	5436	120	120	4072	4072

* 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.