

Fecha de Publicación: 5 de febrero de 2015

Fecha de Información: 03 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\$1302,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	251,2	117,4	50,8	192,5	24,7	16,7	42,0
15-35	359,6	344,6	213,3	193,4	27,8	62,7	103,5
36-60	95,2	81,5	0,0	0,0	81,5	95,2	0,0
61-90	3,9	73,5	30,0	0,0	43,5	3,9	0,0
91-180	22,3	24,2	0,0	0,0	24,2	22,3	0,0
>180	62,1	59,1	0,0	15,0	12,1	0,1	47,0
Total	794,2	700,3	294,1	400,9	213,7	200,8	192,5

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

*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**	17	72	2635	3207	42	82	2626	3598	26	94	2531	2299
Intragrupa y off-shore***	0	0	1697	800	0	0	2234	896	0	0	1420	854
Otros	72	17	624	949	82	42	614	980	94	26	267	1064
Total	88	88	4956	4956	124	124	5474	5474	120	120	4217	4217

* 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.