

Fecha de Publicación: 6 de febrero de 2015

Fecha de Información: 04 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\$1605,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	398,1	120,7	46,9	315,0	18,8	28,1	55,0
15-35	507,8	657,3	405,5	155,8	48,8	149,1	203,0
36-60	57,9	39,0	25,0	0,0	14,0	57,9	0,0
61-90	18,4	32,2	10,0	0,0	22,2	18,4	0,0
91-180	13,0	12,5	0,0	0,0	12,5	13,0	0,0
>180	6,5	0,5	0,0	0,0	0,5	6,5	0,0
Total	1001,7	862,2	487,4	470,8	116,8	272,9	258,0

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

Sector	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**	15	66	2977	3270	42	83	2674	3650	27	93	2541	2312
Intragrupo y off-shore***	0	0	1698	1084	0	0	2279	926	0	0	1422	854
Otros	66	15	629	951	83	42	621	998	93	27	278	1075
Total	82	82	5305	5305	125	125	5574	5574	120	120	4241	4241

* 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.