

Fecha de Publicación: 9 de febrero de 2015

Fecha de Información: 05 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\$1172,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	202,1	200,8	67,5	96,0	101,3	74,1	32,0
15-35	269,4	319,3	253,3	120,0	60,1	143,4	6,0
36-60	0,1	57,1	0,0	0,0	57,1	0,1	0,0
61-90	3,6	47,5	0,0	0,0	47,5	3,6	0,0
91-180	41,1	20,5	10,0	0,0	10,5	41,1	0,0
>180	19,6	29,7	25,0	0,0	4,7	19,6	0,0
Total	536,0	674,9	355,8	216,0	281,2	282,0	38,0

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

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	68	3021	3278	46	84	2753	3768	27	93	2616	2387
Intragruppo y off-shore***	0	0	1706	1128	0	0	2339	949	0	0	1422	883
Otros	68	15	630	950	84	46	663	1038	93	27	337	1105
Total	83	83	5356	5356	129	129	5755	5755	120	120	4375	4375

* 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.