

Fecha de Publicación: 11 de febrero de 2015

Fecha de Información: 09 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\$884,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	141,0	93,2	56,2	110,2	27,0	20,8	10,0
15-35	304,0	176,3	95,0	149,0	36,8	110,5	44,5
36-60	23,1	9,4	0,0	0,0	9,4	23,1	0,0
61-90	15,8	44,0	0,0	0,0	44,0	15,8	0,0
91-180	75,2	31,0	0,0	0,0	31,0	75,2	0,0
>180	0,2	25,9	20,0	0,0	5,9	0,2	0,0
Total	559,4	379,8	171,2	259,2	154,1	245,7	54,5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,0 %	4,7 %	5,6 %	4,6 %
15-35	1,8 %	4,0 %	4,2 %	3,9 %
36-60	-	4,1 %	3,2 %	3,4 %
61-90	-	3,5 %	3,4 %	3,5 %
91-180	-	3,4 %	3,0 %	3,1 %
>180	-	3,1 %	3,0 %	3,1 %
Total	1,5 %	3,9 %	4,0 %	3,8 %

*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	9 al 13 de febrero				16 al 20 de febrero				23 al 27 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	85	2998	3878	27	90	2714	2552	12	93	2503	3637
Intragruppo y off-shore***	0	0	2366	1123	4	0	1481	901	0	0	2355	482
Otros	85	52	706	1068	85	27	383	1124	93	12	512	1252
Total	136	136	6070	6070	116	116	4578	4578	104	104	5371	5371

* 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 intragruppo.