

Fecha de Publicación: 12 de febrero de 2015

Fecha de Información: 10 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\$1634,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	554,9	265,3	91,6	386,5	21,6	16,4	152,0
15-35	285,1	547,6	383,8	32,0	28,8	118,1	135,0
36-60	40,6	66,2	60,0	0,0	6,2	40,6	0,0
61-90	16,2	3,8	0,0	0,0	3,8	16,2	0,0
91-180	65,5	64,0	0,0	0,0	64,0	65,5	0,0
>180	8,9	2,9	0,0	0,0	2,9	8,9	0,0
Total	971,2	949,8	535,4	418,5	127,4	265,7	287,0

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

*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**	54	86	3457	3995	27	90	2777	2669	12	93	2568	3705
Intragrupo y off-shore***	0	0	2368	1478	4	0	1565	931	0	0	2361	484
Otros	86	54	719	1072	85	27	386	1127	93	12	521	1261
Total	139	139	6545	6545	117	117	4727	4727	104	104	5450	5450

* 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.