

Fecha de Publicación: 13 de febrero de 2015

Fecha de Información: 11 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\$1848,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	447,2	140,7	90,0	396,3	25,7	25,9	25,0
15-35	309,4	921,4	716,3	69,5	35,1	69,9	170,0
36-60	19,1	2,8	0,0	0,0	2,8	19,1	0,0
61-90	18,3	12,2	0,0	0,0	12,2	18,3	0,0
91-180	32,8	63,9	0,0	0,0	63,9	32,8	0,0
>180	20,3	54,9	50,0	0,0	4,9	20,3	0,0
Total	847,2	1195,9	856,3	465,8	144,6	186,4	195,0

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

*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	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	87	3874	4058	27	90	2794	2708	12	93	2581	3748
Intragrupo y off-shore***	0	0	2399	1859	4	0	1605	946	0	0	2381	485
Otros	87	54	726	1083	85	27	386	1129	93	12	544	1273
Total	141	141	6999	6999	117	117	4784	4784	104	104	5506	5506

* 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.