

Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2015

Fecha de Información: 12 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\$1584,1 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	246,1	423,9	232,3	132,0	146,6	69,1	45,0
15-35	376,2	441,9	308,3	165,0	61,6	139,2	72,0
36-60	28,5	27,7	0,0	0,0	27,7	28,5	0,0
61-90	19,2	16,8	0,0	15,0	16,8	4,2	0,0
91-180	66,7	63,8	0,0	11,5	43,8	35,2	20,0
>180	10,0	10,3	0,0	0,0	0,3	0,0	10,0
Total	746,7	984,4	540,6	323,5	296,8	276,2	147,0

* 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	1,2 %	3,6 %	2,5 %	3,0 %
15-35	3,1 %	3,9 %	3,7 %	3,8 %
36-60	-	4,0 %	3,4 %	3,7 %
61-90	-	4,0 %	3,3 %	3,7 %
91-180	3,5 %	3,8 %	3,2 %	3,5 %
>180	3,4 %	3,9 %	-	3,4 %
Total	2,6 %	3,8 %	3,2 %	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	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	82	3970	4083	27	90	2839	2826	12	93	2726	4106
Intragruppo y off-shore***	0	0	2412	1945	4	0	1713	981	0	0	2532	527
Otros	82	54	738	1092	85	27	395	1140	93	12	705	1331
Total	135	135	7119	7119	117	117	4947	4947	105	105	5964	5964

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.