

Fecha de Publicación: 17 de febrero de 2015

Fecha de Información: 13 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\$1004,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	104,1	116,4	16,5	57,5	79,9	26,6	20,0
15-35	461,8	310,7	163,7	292,6	76,0	98,2	71,0
36-60	20,0	13,4	0,0	0,0	13,4	20,0	0,0
61-90	1,2	31,1	10,0	0,0	21,1	1,2	0,0
91-180	1,5	25,7	0,0	0,0	25,7	1,5	0,0
>180	6,4	7,7	0,1	0,0	2,6	1,4	5,0
Total	595,0	505,2	190,3	350,1	218,8	148,9	96,0

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

*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	81	3970	4083	27	90	2935	2866	12	94	2734	4183
Intragruppo y off-shore***	0	0	2412	1945	4	0	1714	1033	0	0	2547	533
Otros	81	54	738	1092	86	27	413	1164	94	12	768	1333
Total	134	134	7120	7120	118	118	5063	5063	106	106	6049	6049

* 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.