

Fecha de Publicación: 18 de febrero de 2015

Fecha de Información: 16 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\$91,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	6,5	2,8	0,0	0,0	2,8	6,5	0,0
15-35	27,7	36,0	35,0	0,0	1,0	27,7	0,0
36-60	4,4	0,1	0,0	0,0	0,1	4,4	0,0
61-90	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
91-180	10,4	3,5	0,0	0,0	3,5	10,4	0,0
>180	0,0	0,2	0,0	0,0	0,2	0,0	0,0
Total	49,1	42,7	35,0	0,0	7,7	49,1	0,0

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

*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	16 al 20 de febrero				23 al 27 de febrero				2 al 6 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	90	2938	2871	12	94	2736	4183	9	76	2157	2436
Intragrupo y off-shore***	4	0	1714	1033	0	0	2547	533	0	0	1492	763
Otros	85	27	419	1167	94	12	768	1335	76	9	384	834
Total	117	117	5071	5071	105	105	6051	6051	85	85	4033	4033

* 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.