

Fecha de Publicación: 19 de febrero de 2015

Fecha de Información: 17 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\$1215,2 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	377,1	150,8	71,5	277,8	39,3	59,3	40,0
15-35	264,5	267,6	244,5	85,0	8,1	164,5	15,0
36-60	37,6	1,1	0,0	0,0	1,1	37,6	0,0
61-90	9,2	4,5	0,0	0,0	4,5	9,2	0,0
91-180	68,1	54,5	0,0	0,0	54,5	68,1	0,0
>180	6,9	28,3	20,0	0,0	8,3	6,9	0,0
Total	763,5	506,8	336,0	362,8	115,7	345,7	55,0

* 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	2,1 %	3,8 %	3,5 %	3,4 %
15-35	0,0 %	3,8 %	3,6 %	3,6 %
36-60	-	4,9 %	4,8 %	4,8 %
61-90	-	4,1 %	2,9 %	3,3 %
91-180	-	3,7 %	2,9 %	3,3 %
>180	-	3,5 %	2,7 %	3,3 %
Total	1,5 %	3,8 %	3,6 %	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	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**	28	86	3210	2909	12	94	2814	4296	12	76	2188	2458
Intragruppo y off-shore***	4	0	1727	1277	0	0	2606	552	0	0	1503	778
Otros	82	28	443	1196	94	12	782	1353	76	12	394	850
Total	114	114	5381	5381	106	106	6202	6202	88	88	4085	4085

* 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 intragrupo.