

Fecha de Publicación: 20 de febrero de 2015

Fecha de Información: 18 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\$1482,4 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	237,2	135,3	90,6	172,3	17,7	37,9	27,0
15-35	473,7	510,9	380,0	173,7	26,9	196,0	104,0
36-60	10,8	3,7	1,3	0,0	2,4	10,8	0,0
61-90	28,0	129,4	110,0	0,0	9,4	18,0	10,0
91-180	36,2	31,8	0,0	0,0	31,8	36,2	0,0
>180	24,9	11,6	0,0	0,0	1,6	14,9	10,0
Total	810,8	822,6	581,9	345,9	89,8	313,9	151,0

* 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	1,1 %	2,3 %	2,9 %	2,5 %
15-35	3,4 %	3,6 %	3,9 %	3,7 %
36-60	-	3,9 %	3,4 %	3,6 %
61-90	3,4 %	3,6 %	3,3 %	3,5 %
91-180	-	3,9 %	3,1 %	3,5 %
>180	3,3 %	-0,8 %	3,0 %	2,9 %
Total	3,0 %	3,4 %	3,5 %	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

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	89	3291	2950	10	93	2935	4339	14	76	2258	2549
Intragrupo y off-shore***	4	0	1769	1353	0	0	2639	648	0	0	1531	778
Otros	85	28	444	1200	93	10	793	1379	76	14	395	858
Total	117	117	5504	5504	103	103	6366	6366	89	89	4184	4184

* 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.