

Fecha de Publicación: 23 de febrero de 2015

Fecha de Información: 19 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\$1451,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	175,7	83,4	30,3	96,3	13,1	39,4	40,0
15-35	478,7	693,0	535,0	88,6	29,0	261,1	129,0
36-60	28,5	1,9	0,0	0,0	1,9	28,5	0,0
61-90	33,6	50,0	0,0	0,0	46,0	29,6	4,0
91-180	20,3	16,8	0,0	0,0	16,8	20,3	0,0
>180	36,5	26,1	0,0	0,0	6,1	16,5	20,0
Total	773,1	871,2	565,2	184,9	113,0	395,3	193,0

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

*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

Sectores	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**	34	87	3371	2979	12	98	2994	4360	14	74	2287	2632
Intragrupo y off-shore***	4	0	1774	1420	0	0	2658	678	0	0	1589	778
Otros	83	34	447	1193	98	12	794	1408	74	14	401	867
Total	121	121	5592	5592	110	110	6446	6446	87	87	4276	4276

* 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.