

Fecha de Publicación: 24 de febrero de 2015

Fecha de Información: 20 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\$1154,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	255,1	279,0	149,0	79,5	66,0	111,6	64,0
15-35	257,6	388,0	315,0	90,7	11,5	105,4	61,5
36-60	4,5	2,9	0,0	0,0	2,9	4,5	0,0
61-90	26,2	58,5	25,0	0,0	8,5	1,2	25,0
91-180	11,7	7,0	0,0	0,0	7,0	11,7	0,0
>180	7,3	7,7	0,0	0,0	7,7	7,3	0,0
Total	562,4	743,0	489,0	170,2	103,5	241,7	150,5

* 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	0,9 %	3,6 %	3,5 %	3,2 %
15-35	0,3 %	4,4 %	3,8 %	3,7 %
36-60	-	3,9 %	3,4 %	3,6 %
61-90	3,6 %	3,7 %	2,8 %	3,6 %
91-180	-	4,0 %	2,9 %	3,3 %
>180	-	3,6 %	3,0 %	3,3 %
Total	1,1 %	4,1 %	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**	33	83	3372	2987	12	101	3092	4494	14	72	2443	2769
Intragrupa y off-shore***	4	0	1774	1420	0	0	2730	718	0	0	1665	817
Otros	79	33	456	1194	101	12	832	1442	72	14	421	944
Total	116	116	5601	5601	114	114	6654	6654	86	86	4530	4530

* 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.