

Fecha de Publicación: 26 de febrero de 2015

Fecha de Información: 24 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\$2457,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.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	545,7	165,4	66,0	442,1	47,4	51,6	52,0
15-35	566,4	822,0	628,1	318,0	106,9	161,4	87,0
36-60	12,0	21,2	0,0	0,0	21,2	12,0	0,0
61-90	32,7	178,4	126,4	0,0	42,0	22,7	10,0
91-180	79,6	137,2	71,4	0,0	65,8	79,6	0,0
>180	10,3	40,4	15,0	0,0	20,4	5,3	5,0
Total	1246,7	1364,7	906,9	760,1	303,7	332,6	154,0

* 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	20,8 %	4,2 %	6,0 %	7,3 %
15-35	2,6 %	4,5 %	3,9 %	4,1 %
36-60	-	4,4 %	3,4 %	4,0 %
61-90	3,4 %	3,6 %	3,4 %	3,6 %
91-180	-	3,5 %	3,2 %	3,4 %
>180	3,3 %	3,4 %	3,0 %	3,4 %
Total	7,2 %	4,1 %	4,4 %	4,5 %

* 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	23 al 27 de febrero				2 al 6 de marzo				9 al 13 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	111	3772	4597	14	74	2534	3040	22	110	2160	3229
Intragrupa y off-shore***	0	0	2750	1299	0	0	1812	843	0	0	2213	625
Otros	111	11	843	1468	74	14	526	989	110	22	553	1073
Total	123	123	7365	7365	88	88	4872	4872	132	132	4927	4927

* 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.