

Fecha de Publicación: 27 de febrero de 2015

Fecha de Información: 25 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\$2220,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	442,0	195,5	68,5	310,5	57,0	61,5	70,0
15-35	573,5	804,3	691,3	221,4	25,0	264,1	88,0
36-60	49,5	5,8	0,0	0,0	5,8	49,5	0,0
61-90	0,7	20,9	0,0	0,0	20,9	0,7	0,0
91-180	78,0	188,2	121,5	0,0	36,8	48,0	30,0
>180	2,4	47,6	40,0	0,0	7,6	2,4	0,0
Total	1146,1	1262,2	921,2	531,9	153,0	426,2	188,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,1 %	4,2 %	2,8 %	2,9 %
15-35	1,8 %	5,0 %	3,6 %	4,2 %
36-60	-	4,5 %	3,6 %	3,7 %
61-90	-	1,1 %	3,0 %	1,1 %
91-180	-1,1 %	3,4 %	3,0 %	2,7 %
>180	-	3,3 %	3,2 %	3,3 %
Total	1,1 %	4,5 %	3,2 %	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

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**	10	107	4107	4629	23	75	2573	3133	30	110	2321	3316
Intragruppo y off-shore***	0	0	2750	1595	0	0	1875	851	0	0	2218	632
Otros	107	10	855	1488	75	23	535	999	110	30	595	1187
Total	117	117	7712	7712	98	98	4983	4983	141	141	5135	5135

* 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 intragruppo.