

Fecha de Publicación: 3 de marzo de 2015

Fecha de Información: 27 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\$1200,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.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	160,9	221,6	65,5	63,0	81,1	22,9	75,0
15-35	385,6	445,2	209,0	189,6	108,2	68,0	128,0
36-60	6,6	3,5	0,0	0,0	3,5	6,6	0,0
61-90	1,7	6,3	0,0	0,0	6,3	1,7	0,0
91-180	10,7	19,7	0,0	0,0	19,7	10,7	0,0
>180	58,2	103,3	80,0	35,0	3,3	3,2	20,0
Total	623,6	799,6	354,5	287,6	222,1	113,0	223,0

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

*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**	8	99	4237	4662	25	77	2774	3340	31	112	2421	3536
Intragrupa y off-shore***	0	0	2750	1703	0	0	2006	959	0	0	2301	657
Otros	99	8	869	1491	77	25	551	1031	112	31	672	1202
Total	107	107	7856	7856	102	102	5330	5330	143	143	5394	5394

* 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.