

Fecha de Publicación: 4 de marzo de 2015

Fecha de Información: 02 de marzo 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\$1159,3 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	219,8	215,9	96,0	91,3	26,9	35,6	93,0
15-35	210,3	506,4	414,9	86,0	8,5	41,3	83,0
36-60	21,4	61,3	30,0	0,2	31,3	21,2	0,0
61-90	5,4	13,0	0,0	0,0	13,0	5,4	0,0
91-180	14,8	18,4	5,0	0,0	8,4	9,8	5,0
>180	28,2	35,4	25,0	0,0	0,4	18,2	10,0
Total	499,9	850,4	570,9	177,4	88,5	131,5	191,0

* 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	4,0 %	4,2 %	2,8 %	3,7 %
15-35	4,3 %	3,4 %	3,9 %	3,6 %
36-60	-	4,0 %	3,4 %	3,9 %
61-90	-	3,9 %	3,5 %	3,8 %
91-180	3,4 %	-3,6 %	2,9 %	-0,1 %
>180	3,2 %	3,5 %	1,5 %	2,7 %
Total	4,1 %	3,5 %	3,2 %	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	2 al 6 de marzo				9 al 13 de marzo				16 al 20 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	74	2901	3401	35	116	2508	3660	24	84	3040	3624
Intragrupa y off-shore***	0	0	2025	1050	0	0	2348	657	0	0	2646	1036
Otros	74	25	574	1049	116	35	674	1213	84	24	297	1322
Total	99	99	5500	5500	151	151	5530	5530	108	108	5982	5982

* 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.