

Fecha de Publicación: 5 de marzo de 2015

Fecha de Información: 03 de marzo de 2015¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1,712 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	301.4	150.1	94.3	249.1	25.8	22.3	30.0
15-35	419.3	431.6	364.5	309.8	26.1	68.5	41.0
36-60	32.1	41.1	15.0	3.5	26.1	28.6	0.0
61-90	5.2	24.1	0.0	0.0	24.1	5.2	0.0
91-180	38.7	244.3	169.0	23.8	75.3	14.9	0.0
>180	30.6	65.4	56.8	6.8	7.6	22.7	1.0
Total	827.3	956.6	699.6	593.0	185.0	162.3	72.0

* 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	2.8 %	4.1 %	3.5 %	3.6 %
15-35	4.2 %	4.5 %	3.9 %	4.2 %
36-60	-	4.5 %	4.0 %	4.2 %
61-90	-	4.1 %	3.3 %	3.9 %
91-180	-	3.4 %	3.5 %	3.4 %
>180	3.3 %	3.4 %	3.0 %	3.1 %
Total	3.6 %	4.0 %	3.7 %	3.9 %

*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**	24	67	3063	3472	37	116	2626	3743	26	84	3104	3680
Intragruppo y off-shore***	0	0	2081	1191	0	0	2405	755	0	0	2666	1076
Otros	67	24	579	1060	116	37	690	1223	84	26	312	1327
Total	92	92	5723	5723	153	153	5721	5721	110	110	6083	6083

* 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 intragruppo.