

Fecha de Publicación: 6 de marzo de 2015

Fecha de Información: 04 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\$1,267 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 04%.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	201.2	74.6	45.3	167.8	29.2	33.4	0.0
15-35	388.9	343.1	189.3	194.0	16.8	57.9	137.0
36-60	55.4	58.8	22.8	0.0	15.9	35.4	20.0
61-90	40.1	63.1	26.4	0.0	6.7	10.1	30.0
91-180	18.4	160.4	77.6	0.0	82.8	18.4	0.0
>180	20.8	42.9	0.5	0.0	28.4	6.8	14.0
Total	724.8	742.8	361.9	361.8	179.9	162.0	201.0

* 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	-	6.2 %	4.5 %	4.9 %
15-35	4.4 %	5.1 %	4.2 %	4.6 %
36-60	4.1 %	5.1 %	4.1 %	4.3 %
61-90	3.2 %	0.6 %	3.5 %	2.1 %
91-180	-	2.9 %	2.9 %	2.9 %
>180	3.3 %	3.5 %	1.5 %	3.1 %
Total	4.1 %	4.1 %	4.2 %	4.2 %

* 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

Sectores	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**	26	62	3172	3487	37	117	2690	3782	26	84	3153	3726
Intragrupa y off-shore***	0	0	2086	1294	0	0	2434	799	0	0	2678	1096
Otros	62	26	590	1066	117	37	701	1243	84	26	326	1335
Total	88	88	5848	5848	154	154	5824	5824	110	110	6157	6157

* 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 intragrupo.