

Fecha de Publicación: 9 de marzo de 2015

Fecha de Información: 05 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\$2,240 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.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	539.4	347.1	115.3	258.7	56.7	105.7	175.0
15-35	695.2	634.4	358.5	361.5	29.9	87.7	246.0
36-60	17.3	12.7	6.7	0.0	6.0	17.3	0.0
61-90	19.8	54.1	50.0	0.0	4.1	19.8	0.0
91-180	91.2	110.4	90.0	0.0	15.4	86.2	5.0
>180	13.0	141.6	129.1	0.0	2.5	3.0	10.0
Total	1375.7	1300.3	749.6	620.2	114.7	319.5	436.0

* 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	4.2 %	5.0 %	3.4 %	3.9 %
15-35	4.2 %	4.7 %	3.7 %	4.1 %
36-60	-	4.5 %	3.8 %	4.1 %
61-90	-	3.8 %	3.5 %	3.7 %
91-180	0.0 %	3.2 %	3.2 %	3.1 %
>180	1.8 %	3.1 %	2.6 %	2.8 %
Total	4.1 %	4.4 %	3.5 %	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

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	3345	3606	37	117	2881	3944	27	86	3324	3888
Intragrupa y off-shore***	0	0	2185	1446	0	0	2539	841	0	0	2688	1161
Otros	62	26	589	1067	117	37	703	1337	86	27	379	1341
Total	88	88	6120	6120	154	154	6123	6123	112	112	6391	6391

* 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.