

Fecha de Publicación: 10 de marzo de 2015

Fecha de Información: 06 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\$1,615 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.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	450.6	344.6	125.3	199.8	44.3	75.8	175.0
15-35	330.7	512.0	406.3	67.0	27.7	185.7	78.0
36-60	16.6	9.3	0.0	0.0	9.3	16.6	0.0
61-90	0.1	2.5	0.0	0.0	2.5	0.1	0.0
91-180	44.2	104.1	95.0	0.0	9.1	44.2	0.0
>180	10.7	42.9	40.0	0.0	2.9	10.7	0.0
Total	852.9	1015.3	666.5	266.8	95.8	333.1	253.0

* 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	3.9 %	4.0 %	3.2 %	3.6 %
15-35	1.5 %	4.3 %	4.0 %	3.9 %
36-60	-	4.3 %	3.1 %	3.5 %
61-90	-	4.4 %	3.3 %	4.4 %
91-180	-	4.0 %	3.3 %	3.8 %
>180	-	3.7 %	2.8 %	3.5 %
Total	3.2 %	4.1 %	3.5 %	3.8 %

* 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	61	3345	3606	40	119	3142	4142	28	86	3509	4031
Intragrupa y off-shore***	0	0	2185	1446	0	0	2586	946	0	0	2766	1256
Otros	61	26	590	1068	119	40	743	1384	86	28	378	1366
Total	87	87	6120	6120	159	159	6471	6471	114	114	6653	6653

* 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.