

Fecha de Publicación: 12 de marzo de 2015

Fecha de Información: 10 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\$1,924 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.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	484.1	106.0	61.3	438.5	7.7	8.6	37.0
15-35	374.3	731.8	609.8	156.3	32.0	128.0	90.0
36-60	3.4	15.3	0.1	0.0	15.2	3.4	0.0
61-90	10.1	69.4	0.0	0.0	69.4	10.1	0.0
91-180	72.1	126.2	92.0	0.4	29.2	66.7	5.0
>180	23.1	46.5	22.6	0.0	17.4	16.6	6.5
Total	967.1	1095.2	785.7	595.2	171.0	233.4	138.5

* 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	4.3 %	5.0 %	-3.3 %	-1.4 %
15-35	4.5 %	3.9 %	4.5 %	4.2 %
36-60	-	4.5 %	3.8 %	4.4 %
61-90	-	4.2 %	3.6 %	4.2 %
91-180	0.0 %	4.2 %	3.6 %	3.8 %
>180	0.8 %	3.7 %	3.5 %	3.4 %
Total	4.1 %	4.1 %	0.7 %	2.6 %

* 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	9 al 13 de marzo				16 al 20 de marzo				23 al 27 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	39	105	3899	4215	28	93	3712	4239	9	71	2070	2220
Intragruppo y off-shore***	0	0	2625	1645	3	0	2876	1358	0	0	1541	547
Otros	105	39	767	1432	90	28	380	1370	71	9	354	1198
Total	143	143	7291	7291	122	122	6968	6968	79	79	3965	3965

* 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.