

Fecha de Publicación: 13 de marzo de 2015

Fecha de Información: 11 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\$1,128 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.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	240.9	121.1	97.6	201.7	9.5	25.2	14.0
15-35	287.0	257.7	237.5	159.7	15.2	122.3	5.0
36-60	7.1	13.6	0.0	0.0	13.6	7.1	0.0
61-90	6.1	29.3	6.0	0.0	23.3	6.1	0.0
91-180	45.8	67.8	45.0	1.2	22.8	44.6	0.0
>180	12.1	64.2	35.0	0.0	23.1	6.0	6.1
Total	599.0	553.7	421.1	362.6	107.5	211.3	25.1

* 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	4.7 %	5.3 %	4.6 %	4.8 %
15-35	4.6 %	4.7 %	3.4 %	4.0 %
36-60	-	4.9 %	3.8 %	4.5 %
61-90	-	4.3 %	2.5 %	4.0 %
91-180	-	4.4 %	4.0 %	4.2 %
>180	0.7 %	3.8 %	3.7 %	3.5 %
Total	3.7 %	4.7 %	3.9 %	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	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	4056	4302	29	93	3858	4338	9	71	2089	2225
Intragrupa y off-shore***	0	0	2698	1766	3	0	2969	1502	0	0	1543	557
Otros	105	39	767	1454	90	29	386	1373	71	9	357	1207
Total	144	144	7522	7522	122	122	7213	7213	80	80	3989	3989

* 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.