

Fecha de Publicación: 17 de marzo de 2015

Fecha de Información: 13 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\$1,341 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.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	110.9	179.9	148.5	68.8	11.4	22.1	20.0
15-35	646.0	372.3	225.5	282.2	8.3	225.3	138.5
36-60	25.1	31.0	0.0	0.0	11.0	5.1	20.0
61-90	23.2	13.2	0.0	0.0	3.2	13.2	10.0
91-180	24.1	32.8	20.1	1.7	12.7	22.5	0.0
>180	8.5	67.8	30.0	2.2	32.8	1.3	5.0
Total	837.8	696.9	424.1	354.8	79.3	289.5	193.5

* 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	4.4 %	4.5 %	3.9 %	4.4 %
15-35	3.8 %	4.4 %	4.2 %	4.2 %
36-60	4.4 %	4.8 %	3.3 %	4.4 %
61-90	4.3 %	7.7 %	3.7 %	4.4 %
91-180	-	3.9 %	3.8 %	3.9 %
>180	4.0 %	4.0 %	3.6 %	4.0 %
Total	4.0 %	4.4 %	4.1 %	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	104	4262	4383	29	96	4164	4734	9	72	2202	2476
Intragruppo y off-shore***	0	0	2742	1929	3	0	3242	1700	0	0	1723	588
Otros	104	39	775	1467	93	29	428	1400	71	9	398	1259
Total	143	143	7779	7779	125	125	7834	7834	80	80	4323	4323

* 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: $((\text{Tasa Pactada/Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.