

Fecha de Publicación: 18 de marzo de 2015

Fecha de Información: 16 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\$1,087 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.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	118.7	195.5	164.5	91.2	31.0	27.5	0.0
15-35	363.2	234.1	211.2	132.0	20.9	229.2	2.0
36-60	11.0	7.2	0.0	0.0	7.2	11.0	0.0
61-90	4.7	12.3	0.0	0.0	12.3	4.7	0.0
91-180	66.3	17.3	0.0	0.0	17.3	66.3	0.0
>180	13.9	49.7	40.0	0.6	4.7	8.3	5.0
Total	577.9	516.1	415.7	223.8	93.4	347.1	7.0

* 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 %	2.1 %	3.3 %
15-35	4.5 %	4.1 %	4.1 %	4.1 %
36-60	-	4.8 %	4.0 %	4.3 %
61-90	-	4.6 %	3.6 %	4.3 %
91-180	-	-8.7 %	3.9 %	1.3 %
>180	4.0 %	4.1 %	3.7 %	4.1 %
Total	4.2 %	3.6 %	3.8 %	3.7 %

* 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	16 al 20 de marzo				23 al 27 de marzo				30 de mar. al 3 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	88	4263	4824	9	74	2229	2587	14	113	1707	2117
Intragrupa y off-shore***	3	0	3318	1779	0	0	1812	599	0	0	1280	809
Otros	85	29	443	1420	74	9	420	1275	113	14	324	386
Total	117	117	8023	8023	84	84	4461	4461	127	127	3311	3311

* 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.