

Fecha de Publicación: 19 de marzo de 2015

Fecha de Información: 17 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\$1,552 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.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	324.9	217.4	138.5	231.8	58.9	73.1	20.0
15-35	534.4	237.2	132.3	202.1	16.4	243.7	88.6
36-60	45.4	57.5	30.3	0.0	27.3	45.4	0.0
61-90	3.5	28.6	0.0	0.0	28.6	3.5	0.0
91-180	31.0	119.5	77.0	0.0	42.5	31.0	0.0
>180	17.1	59.4	35.0	0.0	9.4	2.1	15.0
Total	956.2	719.7	413.0	433.9	183.0	398.7	123.6

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.7 %	5.3 %	3.9 %	4.5 %
15-35	4.4 %	4.6 %	4.4 %	4.5 %
36-60	-	4.7 %	4.1 %	4.5 %
61-90	-	4.6 %	3.9 %	4.5 %
91-180	-	4.2 %	4.1 %	4.2 %
>180	3.9 %	4.2 %	3.5 %	4.1 %
Total	4.4 %	4.7 %	4.2 %	4.4 %

*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	87	4410	4853	9	76	2264	2723	13	146	1850	2143
Intragruppo y off-shore***	3	0	3329	1926	0	0	1939	624	0	0	1280	869
Otros	84	29	461	1420	76	9	428	1285	146	13	331	448
Total	116	116	8199	8199	85	85	4632	4632	158	158	3460	3460

* 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 intragruppo.