

Fecha de Publicación: 20 de marzo de 2015

Fecha de Información: 18 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\$1,954 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.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	618.4	219.8	104.0	498.5	27.8	31.9	88.0
15-35	441.6	558.4	429.0	180.8	127.4	258.8	2.0
36-60	3.7	19.7	4.4	0.0	15.3	3.7	0.0
61-90	20.9	62.4	0.0	0.0	62.4	20.9	0.0
91-180	55.3	38.6	0.0	0.0	38.6	55.3	0.0
>180	1.8	3.1	0.0	0.0	3.1	1.8	0.0
Total	1141.7	902.1	537.4	679.3	274.7	372.5	90.0

* 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	4.0 %	3.4 %	3.0 %	3.2 %
15-35	4.2 %	4.4 %	4.8 %	4.5 %
36-60	-	4.8 %	3.5 %	4.5 %
61-90	-	4.4 %	3.9 %	4.3 %
91-180	-	3.9 %	3.3 %	3.5 %
>180	-	4.4 %	3.5 %	4.1 %
Total	4.0 %	4.2 %	3.8 %	4.0 %

*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	85	4898	4899	10	77	2349	2847	13	156	1918	2196
Intragrupa y off-shore***	3	0	3357	2382	0	0	2015	667	0	0	1280	869
Otros	82	29	463	1437	77	10	436	1286	156	13	338	470
Total	114	114	8718	8718	87	87	4800	4800	168	168	3535	3535

* 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.