

Fecha de Publicación: 25 de marzo de 2015

Fecha de Información: 20 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\$1,713 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.8%.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	236.9	33.3	9.0	201.6	19.3	30.3	5.0
15-35	760.2	623.9	438.6	407.5	75.3	242.7	110.0
36-60	0.8	16.8	0.0	0.0	16.8	0.8	0.0
61-90	1.9	12.9	0.0	0.0	12.9	1.9	0.0
91-180	26.6	73.1	10.0	0.0	43.1	6.6	20.0
>180	23.5	50.5	0.0	10.0	38.0	1.0	12.5
Total	1050.0	810.5	457.6	619.1	205.4	283.3	147.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	37.7 %	6.6 %	8.1 %	8.8 %
15-35	4.1 %	4.4 %	4.2 %	4.3 %
36-60	-	4.8 %	3.5 %	4.7 %
61-90	-	4.7 %	4.0 %	4.6 %
91-180	3.9 %	4.1 %	3.7 %	4.0 %
>180	3.6 %	4.3 %	4.0 %	4.1 %
Total	5.1 %	4.5 %	4.9 %	4.8 %

*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**	30	88	5055	4951	14	83	2633	2957	13	158	1954	2273
Intragruppo y off-shore***	3	0	3408	2526	0	0	2059	888	0	0	1338	897
Otros	85	30	459	1444	83	14	487	1334	158	13	351	473
Total	118	118	8921	8921	97	97	5179	5179	171	171	3642	3642

* 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 intragruppo.