

Fecha de Publicación: 26 de marzo de 2015

Fecha de Información: 24 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\$1,515 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.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	88.6	191.0	76.4	4.2	75.7	45.4	39.0
15-35	664.0	318.6	141.0	348.8	56.3	193.9	121.3
36-60	33.3	51.1	0.0	0.0	46.1	28.3	5.0
61-90	5.9	19.5	0.6	0.0	18.9	5.9	0.0
91-180	56.0	229.7	30.0	0.0	159.7	16.0	40.0
>180	30.1	47.0	5.0	15.0	27.0	0.1	15.0
Total	877.9	856.9	252.9	367.9	383.7	289.7	220.3

* 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 %	11.9 %	0.5 %	7.8 %
15-35	3.9 %	4.5 %	4.4 %	4.4 %
36-60	3.5 %	3.9 %	3.7 %	3.8 %
61-90	-	4.2 %	3.4 %	4.0 %
91-180	4.0 %	4.0 %	3.4 %	4.0 %
>180	3.9 %	4.0 %	3.9 %	3.9 %
Total	4.0 %	5.7 %	4.0 %	4.7 %

*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	23 al 27 de marzo				30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	87	2687	3059	13	158	1985	2324	11	89	2690	2754
Intragruppo y off-shore***	0	0	2091	889	0	0	1372	897	0	0	1869	915
Otros	87	9	535	1365	158	13	351	487	88	11	524	1414
Total	96	96	5313	5313	171	171	3708	3708	99	99	5082	5082

* 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.