

Fecha de Publicación: 27 de marzo de 2015

Fecha de Información: 25 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\$1,394 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	218.8	211.9	49.6	145.9	148.3	58.9	14.0
15-35	330.5	356.8	254.0	118.5	48.8	158.0	54.0
36-60	62.6	37.8	10.0	6.8	27.3	55.3	0.5
61-90	7.7	27.1	0.1	0.0	27.0	7.7	0.0
91-180	113.8	77.9	24.0	20.0	23.9	63.8	30.0
>180	21.2	46.8	15.0	0.0	11.8	1.2	20.0
Total	754.6	758.2	352.7	291.1	287.0	345.0	118.5

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.9 %	4.3 %	3.3 %	3.8 %
15-35	3.6 %	3.2 %	3.1 %	3.2 %
36-60	3.7 %	4.1 %	3.5 %	3.7 %
61-90	-	4.1 %	3.3 %	3.9 %
91-180	3.9 %	4.1 %	3.5 %	3.7 %
>180	3.9 %	4.0 %	2.9 %	4.0 %
Total	3.5 %	3.8 %	3.2 %	3.5 %

*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**	10	88	2805	3168	13	162	2047	2361	11	90	2736	2821
Intragrupa y off-shore***	0	0	2092	984	0	0	1395	924	0	0	1897	939
Otros	88	10	635	1382	162	13	359	515	90	11	563	1436
Total	98	98	5533	5533	175	175	3800	3800	101	101	5196	5196

* 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.