

Fecha de Publicación: 30 de marzo de 2015

Fecha de Información: 26 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\$2,126 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.6%.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	756.0	352.6	84.0	491.7	62.2	57.8	206.5
15-35	289.5	631.8	586.0	140.9	26.8	129.7	19.0
36-60	11.1	40.3	12.0	0.0	28.3	11.1	0.0
61-90	31.1	15.2	0.0	0.0	15.2	31.1	0.0
91-180	48.4	127.1	71.0	0.0	56.1	48.4	0.0
>180	12.0	36.5	6.0	0.0	30.5	12.0	0.0
Total	1148.0	1203.5	759.0	632.5	219.0	290.0	225.5

* 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	4.1 %	5.3 %	2.3 %	3.4 %
15-35	3.8 %	3.7 %	3.6 %	3.7 %
36-60	-	4.0 %	3.6 %	3.9 %
61-90	-	4.1 %	3.6 %	3.7 %
91-180	-	4.1 %	3.5 %	3.9 %
>180	-	4.0 %	3.8 %	3.9 %
Total	4.1 %	4.1 %	2.9 %	3.6 %

*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	84	3157	3179	13	163	2235	2542	11	91	2955	2982
Intragruppo y off-shore***	0	0	2098	1332	0	0	1451	1007	0	0	1919	999
Otros	84	9	639	1382	163	13	408	546	91	11	573	1465
Total	94	94	5894	5894	177	177	4094	4094	102	102	5446	5446

* 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.