

Fecha de Publicación: 31 de marzo de 2015

Fecha de Información: 27 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\$1,004 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.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	154.7	164.6	124.5	65.2	10.1	59.5	30.0
15-35	220.9	446.5	344.0	40.0	12.5	90.9	90.0
36-60	30.1	9.0	0.0	9.0	9.0	21.1	0.0
61-90	12.5	13.6	4.8	0.0	8.8	12.5	0.0
91-180	2.4	31.7	9.1	0.0	22.6	2.4	0.0
>180	1.0	36.5	25.0	0.0	11.5	1.0	0.0
Total	421.6	702.0	507.4	114.2	74.6	187.5	120.0

* 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	3.7 %	4.0 %	3.3 %	3.6 %
15-35	3.9 %	4.0 %	3.5 %	3.9 %
36-60	-	4.4 %	3.6 %	3.8 %
61-90	-	4.1 %	3.6 %	3.9 %
91-180	-	4.3 %	3.6 %	4.2 %
>180	-	4.2 %	3.7 %	4.2 %
Total	3.9 %	4.1 %	3.4 %	3.8 %

*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	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	83	3157	3180	16	174	2320	2621	21	92	3010	3058
Intragrupa y off-shore***	0	0	2098	1332	0	0	1503	1022	0	0	1991	1049
Otros	83	10	640	1382	174	16	405	586	92	21	576	1470
Total	93	93	5895	5895	190	190	4228	4228	113	113	5577	5577

* 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.