

Fecha de Publicación: 31 de marzo de 2015

Fecha de Información: 30 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\$1,369 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.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	391.8	124.4	65.5	307.8	24.7	49.8	34.2
15-35	233.3	521.9	407.2	77.5	13.2	54.3	101.5
36-60	21.5	22.3	20.0	0.0	2.3	21.5	0.0
61-90	10.6	64.0	30.0	0.0	34.0	10.6	0.0
91-180	76.7	23.1	12.0	0.0	11.1	76.7	0.0
>180	12.9	12.4	0.0	0.9	2.4	2.0	10.0
Total	746.8	768.2	534.7	386.2	87.8	215.0	145.7

* 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	5.8 %	5.1 %	5.3 %	5.3 %
15-35	4.4 %	4.9 %	4.0 %	4.6 %
36-60	-	4.5 %	3.9 %	3.9 %
61-90	-	4.2 %	3.5 %	4.1 %
91-180	-	4.3 %	3.6 %	3.8 %
>180	4.0 %	4.8 %	4.1 %	4.2 %
Total	4.7 %	4.8 %	4.6 %	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	30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril				13 al 17 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	169	2504	2633	21	94	3198	3161	25	131	2382	2354
Intragrupa y off-shore***	0	0	1508	1190	0	0	2052	1189	0	0	1633	941
Otros	169	16	398	588	94	21	598	1498	131	25	381	1101
Total	185	185	4410	4410	115	115	5848	5848	157	157	4396	4396

* 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.