

Fecha de Publicación: 6 de abril de 2015

Fecha de Información: 31 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\$1,401 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.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	194.0	162.5	93.5	112.0	39.0	52.0	30.0
15-35	389.5	586.7	294.7	80.5	155.0	172.0	137.0
36-60	42.4	76.4	20.0	0.0	16.4	2.4	40.0
61-90	3.5	9.0	6.6	0.0	2.4	3.5	0.0
91-180	32.5	98.7	0.0	0.2	73.7	7.3	25.0
>180	24.1	33.5	10.0	0.0	3.5	4.1	20.0
Total	686.1	966.8	424.7	192.7	290.1	241.4	252.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.5 %	4.4 %	4.0 %	4.2 %
15-35	5.5 %	4.4 %	4.0 %	4.5 %
36-60	3.7 %	5.2 %	3.7 %	4.4 %
61-90	-	4.1 %	3.8 %	4.0 %
91-180	4.3 %	4.6 %	3.4 %	4.5 %
>180	4.0 %	4.3 %	3.6 %	4.1 %
Total	4.9 %	4.5 %	4.0 %	4.4 %

*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	141	2524	2659	21	100	3370	3317	25	132	2476	2393
Intragruppo y off-shore***	0	0	1508	1210	0	0	2145	1281	0	0	1633	945
Otros	141	16	425	587	100	21	631	1548	132	25	389	1161
Total	157	157	4456	4456	121	121	6146	6146	157	157	4499	4499

* 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.