

Fecha de Publicación: 13 de mayo de 2015

Fecha de Información: 11 de mayo 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\$1421.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	447.6	239.0	27.5	177.8	9.3	67.6	202.2
15-35	267.8	381.2	281.1	72.0	48.6	144.3	51.5
36-60	92.7	1.7	0.0	0.0	1.7	92.7	0.0
61-90	3.7	13.5	0.0	0.0	13.5	3.7	0.0
91-180	107.2	29.2	1.0	0.3	28.2	106.9	0.0
>180	65.0	36.6	20.1	0.0	6.5	55.0	10.0
Total	984.0	701.2	329.7	250.1	107.8	470.2	263.7

* 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	2.7 %	2.3 %	1.6 %	2.2 %
15-35	2.6 %	2.8 %	2.2 %	2.5 %
36-60	-	3.2 %	2.1 %	2.1 %
61-90	-	3.1 %	2.4 %	2.9 %
91-180	-	3.5 %	2.9 %	3.1 %
>180	3.6 %	4.0 %	3.5 %	3.7 %
Total	2.7 %	2.9 %	2.3 %	2.5 %

*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	11 al 15 de mayo				18 al 22 de mayo				25 al 29 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	132	4020	3818	31	127	2824	2531	32	83	2010	2095
Intragrupa y off-shore***	0	0	2211	1627	25	0	1283	776	0	18	1062	449
Otros	132	36	705	1490	102	31	388	1188	83	14	605	1133
Total	169	169	6935	6935	158	158	4495	4495	115	115	3677	3677

* 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.