

Fecha de Publicación: 14 de mayo de 2015

Fecha de Información: 12 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\$1762.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	365.3	250.9	111.0	286.0	106.9	46.3	33.0
15-35	449.5	362.5	248.0	217.8	21.5	138.7	93.0
36-60	101.7	58.4	0.0	14.0	43.4	72.7	15.0
61-90	15.4	28.2	0.0	0.0	28.2	15.4	0.0
91-180	40.1	126.9	14.0	0.0	82.9	10.1	30.0
>180	46.3	88.9	70.0	0.0	18.9	46.3	0.0
Total	1018.3	915.7	443.0	517.8	301.7	329.5	171.0

* 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	3.0 %	3.7 %	3.9 %	3.8 %
15-35	2.9 %	2.9 %	1.8 %	2.4 %
36-60	3.1 %	3.4 %	2.5 %	2.8 %
61-90	-	3.3 %	3.1 %	3.2 %
91-180	3.4 %	3.9 %	2.6 %	3.7 %
>180	-	3.9 %	3.4 %	3.7 %
Total	3.0 %	3.5 %	2.9 %	3.2 %

* 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	130	4281	3887	21	127	2898	2673	33	83	2043	2148
Intragrupa y off-shore***	0	0	2245	1868	25	0	1323	791	0	18	1099	479
Otros	130	36	731	1502	103	21	464	1222	83	15	622	1137
Total	166	166	7257	7257	149	149	4685	4685	115	115	3764	3764

* 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.