

Fecha de Publicación: 19 de mayo de 2015

Fecha de Información: 14 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\$1407.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.8%.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	210.0	101.4	42.5	150.0	23.9	25.0	35.0
15-35	471.5	520.5	378.0	120.9	72.5	280.6	70.0
36-60	11.2	5.9	0.0	0.0	5.9	11.2	0.0
61-90	46.1	46.6	15.0	0.0	1.6	16.1	30.0
91-180	31.4	114.3	20.0	0.0	64.3	1.4	30.0
>180	11.1	12.3	0.0	0.0	2.3	1.1	10.0
Total	781.4	801.0	455.5	270.9	170.5	335.5	175.0

* 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	2.7 %	2.9 %	2.3 %	2.5 %
15-35	2.4 %	3.0 %	2.7 %	2.8 %
36-60	-	3.2 %	2.6 %	2.8 %
61-90	1.6 %	3.2 %	3.1 %	2.4 %
91-180	3.6 %	3.9 %	3.3 %	3.8 %
>180	3.9 %	4.1 %	2.8 %	3.8 %
Total	2.6 %	3.1 %	2.6 %	2.8 %

* 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	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**	38	129	4781	3934	74	128	3195	2906	33	83	2230	2381
Intragrupa y off-shore***	0	0	2288	2350	25	0	1479	1009	0	18	1155	489
Otros	129	38	712	1497	104	74	494	1254	83	15	670	1186
Total	167	167	7782	7782	203	203	5169	5169	115	115	4055	4055

* 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.