

Fecha de Publicación: 20 de mayo de 2015

Fecha de Información: 15 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\$1187.6 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	113.4	91.1	41.2	54.8	31.2	39.8	18.8
15-35	398.6	618.4	442.8	47.0	11.9	187.8	163.8
36-60	40.3	8.0	7.5	0.0	0.5	40.3	0.0
61-90	49.4	9.2	7.5	0.0	1.8	49.4	0.0
91-180	2.7	29.7	18.9	0.0	10.8	2.7	0.0
>180	6.0	3.3	0.0	0.0	3.3	6.0	0.0
Total	610.4	759.8	517.7	101.8	59.4	326.0	182.6

* 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	0.9 %	3.3 %	2.0 %	2.5 %
15-35	2.8 %	3.7 %	3.0 %	3.3 %
36-60	-	4.1 %	2.9 %	2.9 %
61-90	-	3.9 %	3.2 %	3.2 %
91-180	-	4.0 %	3.2 %	3.9 %
>180	-	4.4 %	3.1 %	3.6 %
Total	2.7 %	3.7 %	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**	38	129	4782	3935	76	131	3271	2950	33	82	2265	2426
Intragrupa y off-shore***	0	0	2288	2350	25	0	1496	1049	0	18	1179	504
Otros	129	38	713	1498	106	76	503	1271	82	15	692	1206
Total	166	166	7783	7783	207	207	5270	5270	114	114	4136	4136

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.