

Fecha de Publicación: 25 de mayo de 2015

Fecha de Información: 21 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\$1409.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	265.4	93.6	18.5	188.5	23.1	25.0	52.0
15-35	407.0	588.0	460.1	95.0	36.0	220.0	92.0
36-60	49.9	5.3	0.0	0.0	5.3	49.9	0.0
61-90	49.0	3.8	0.0	0.0	3.8	49.0	0.0
91-180	6.8	13.4	0.0	0.0	13.4	6.8	0.0
>180	65.8	10.3	0.0	5.0	5.3	55.8	5.0
Total	844.0	714.5	478.6	288.5	86.9	406.5	149.0

* 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	0.8 %	4.6 %	2.4 %	2.4 %
15-35	3.6 %	3.7 %	3.3 %	3.5 %
36-60	-	4.2 %	3.3 %	3.4 %
61-90	-	4.4 %	3.8 %	3.8 %
91-180	-	4.3 %	3.3 %	3.9 %
>180	3.7 %	4.3 %	3.7 %	3.8 %
Total	2.6 %	3.8 %	3.2 %	3.3 %

* 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	18 al 22 de mayo				25 al 29 de mayo				1 al 5 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	80	124	3784	3173	38	86	2688	2681	9	76	2892	2934
Intragruppo y off-shore***	25	0	1619	1478	0	18	1338	793	0	0	1974	840
Otros	99	80	546	1298	86	20	721	1273	76	9	392	1483
Total	204	204	5949	5949	124	124	4747	4747	85	85	5257	5257

* 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.