

Fecha de Publicación: 7 de abril de 2015

Fecha de Información: 01 de abril 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\$587 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.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	188.9	157.8	105.5	104.0	9.3	41.9	43.0
15-35	170.4	59.8	44.5	160.0	10.3	5.4	5.0
36-60	1.8	2.8	0.0	0.0	2.8	1.8	0.0
61-90	1.1	12.9	0.0	0.0	12.9	1.1	0.0
91-180	8.1	9.6	0.5	0.0	9.0	8.1	0.0
>180	0.8	20.7	20.0	0.0	0.7	0.8	0.0
Total	371.1	263.6	170.5	264.0	45.1	59.1	48.0

* 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	4.5 %	3.8 %	3.3 %	3.7 %
15-35	4.2 %	4.6 %	4.1 %	4.3 %
36-60	-	4.6 %	3.7 %	4.3 %
61-90	-	4.7 %	3.9 %	4.6 %
91-180	-	4.7 %	3.8 %	4.3 %
>180	-	4.0 %	3.3 %	3.9 %
Total	4.5 %	4.1 %	3.7 %	3.9 %

* 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	30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril				13 al 17 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	5	139	2524	2658	30	101	3485	3460	27	135	2552	2400
Intragrupa y off-shore***	0	0	1508	1210	0	0	2244	1343	0	0	1640	987
Otros	139	5	423	587	101	30	632	1558	135	27	389	1195
Total	144	144	4455	4455	131	131	6361	6361	162	162	4582	4582

* 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.