

Fecha de Publicación: 8 de abril de 2015

Fecha de Información: 06 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\$945 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	200.4	304.7	171.6	71.5	43.2	38.9	90.0
15-35	147.7	169.0	79.5	62.5	46.5	42.2	43.0
36-60	32.9	28.2	0.0	0.0	24.0	28.7	4.2
61-90	0.2	29.4	0.0	0.0	29.4	0.2	0.0
91-180	85.4	54.1	2.5	0.0	51.6	85.4	0.0
>180	21.4	8.9	0.0	0.0	8.9	21.4	0.0
Total	487.9	594.3	253.5	134.0	203.6	216.7	137.2

* 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 %	3.8 %	2.6 %	3.3 %
15-35	4.1 %	5.5 %	3.9 %	4.7 %
36-60	3.9 %	4.1 %	3.8 %	3.9 %
61-90	-	4.4 %	3.9 %	4.4 %
91-180	-	4.2 %	3.7 %	3.9 %
>180	-	4.6 %	3.8 %	4.0 %
Total	3.4 %	4.3 %	3.4 %	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	6 al 10 de abril				13 al 17 de abril				20 al 24 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	99	3615	3553	30	138	2616	2581	11	106	2596	2328
Intragrupa y off-shore***	0	0	2276	1400	0	0	1755	1002	0	0	1496	1033
Otros	99	30	644	1582	138	30	415	1204	106	11	441	1172
Total	130	130	6535	6535	168	168	4786	4786	117	117	4533	4533

* 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.