

Fecha de Publicación: 9 de abril de 2015

Fecha de Información: 07 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\$1,754 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.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	482.1	343.2	90.0	247.0	90.2	72.1	163.0
15-35	568.1	268.7	180.0	303.3	30.7	206.8	58.0
36-60	34.3	60.6	17.0	0.0	43.6	34.3	0.0
61-90	5.0	70.6	0.2	0.0	70.4	5.0	0.0
91-180	41.3	48.2	0.9	0.0	47.3	41.3	0.0
>180	31.3	31.9	3.3	20.0	18.6	1.3	10.0
Total	1162.1	823.3	291.4	570.3	300.9	360.8	231.0

* 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	4.1 %	4.5 %	3.7 %	4.0 %
15-35	4.5 %	4.9 %	4.0 %	4.3 %
36-60	-	4.3 %	3.9 %	4.2 %
61-90	-	4.4 %	3.9 %	4.4 %
91-180	-	4.2 %	3.7 %	4.0 %
>180	4.1 %	4.4 %	4.0 %	4.2 %
Total	4.2 %	4.6 %	3.9 %	4.2 %

* 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

Sector	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	104	3874	3655	28	139	2753	2727	11	107	2694	2423
Intragruppo y off-shore***	0	0	2286	1575	0	0	1835	1074	0	0	1496	1033
Otros	104	30	651	1581	139	28	468	1255	107	11	471	1205
Total	135	135	6811	6811	168	168	5056	5056	118	118	4661	4661

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