

Fecha de Publicación: 10 de abril de 2015

Fecha de Información: 08 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\$2,407 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.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	622.7	321.3	139.0	526.0	172.3	86.7	10.0
15-35	653.3	602.4	501.6	321.8	29.7	260.5	71.0
36-60	2.0	23.6	0.0	0.0	23.6	2.0	0.0
61-90	0.9	17.9	0.0	0.0	17.9	0.9	0.0
91-180	1.0	152.6	110.0	0.0	42.6	1.0	0.0
>180	50.7	39.5	10.0	10.0	29.5	40.7	0.0
Total	1330.6	1157.2	760.6	857.8	315.6	391.8	81.0

* 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	4.2 %	4.3 %	-0.9 %	1.2 %
15-35	4.1 %	4.1 %	3.7 %	3.9 %
36-60	-	4.8 %	3.2 %	4.7 %
61-90	-	4.3 %	3.7 %	4.3 %
91-180	-	4.1 %	0.5 %	4.1 %
>180	-	4.1 %	3.8 %	4.0 %
Total	4.1 %	4.2 %	1.7 %	2.9 %

* 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**	34	102	4285	3699	29	143	2907	2908	11	111	2768	2532
Intragruppo y off-shore***	0	0	2328	1985	0	0	1872	1139	0	0	1579	1084
Otros	102	34	654	1583	143	29	607	1339	111	11	487	1218
Total	136	136	7267	7267	172	172	5385	5385	122	122	4834	4834

* 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.