

Fecha de Publicación: 14 de abril de 2015

Fecha de Información: 10 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\$1,360 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	423.8	426.9	191.0	136.0	29.9	81.8	206.0
15-35	231.0	330.1	268.5	69.0	20.6	121.0	41.0
36-60	17.5	5.3	0.0	0.0	5.3	17.5	0.0
61-90	7.5	34.3	25.6	0.0	8.7	7.5	0.0
91-180	7.7	32.2	20.0	0.0	12.2	7.7	0.0
>180	56.6	34.4	10.0	30.1	24.4	26.5	0.0
Total	743.9	863.2	515.1	235.1	101.1	261.8	247.0

* 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	3.9 %	1.7 %	1.8 %	2.6 %
15-35	4.3 %	3.6 %	3.8 %	3.8 %
36-60	-	-3.2 %	3.2 %	1.7 %
61-90	-	4.0 %	4.0 %	4.0 %
91-180	-	4.2 %	3.3 %	4.0 %
>180	-	4.1 %	3.2 %	3.7 %
Total	4.0 %	3.0 %	2.8 %	3.2 %

*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

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**	36	97	4328	3707	42	143	3216	3268	11	114	3007	2815
Intragruppo y off-shore***	0	0	2328	2022	0	0	2094	1285	0	0	1688	1146
Otros	96	36	662	1588	143	42	642	1400	114	11	506	1240
Total	132	132	7317	7317	185	185	5952	5952	125	125	5201	5201

* 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.