

Fecha de Publicación: 15 de abril de 2015

Fecha de Información: 13 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\$1,402 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.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	159.0	153.4	104.5	81.0	33.9	63.0	15.0
15-35	319.1	541.7	492.8	118.0	4.4	156.6	44.5
36-60	62.2	99.7	70.0	0.0	29.7	62.2	0.0
61-90	0.5	4.1	0.5	0.0	3.5	0.5	0.0
91-180	87.4	49.3	0.0	0.0	24.3	62.4	25.0
>180	8.6	2.0	0.0	0.0	2.0	8.6	0.0
Total	636.8	850.2	667.8	199.0	97.9	353.3	84.5

* 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 %	4.6 %	4.0 %	4.3 %
15-35	4.9 %	2.9 %	4.2 %	3.5 %
36-60	-	4.5 %	4.0 %	4.3 %
61-90	-	4.6 %	3.8 %	4.5 %
91-180	4.2 %	4.4 %	3.8 %	4.0 %
>180	-	4.3 %	3.6 %	3.7 %
Total	4.6 %	3.5 %	4.1 %	3.8 %

* 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	13 al 17 de abril				20 al 24 de abril				27 de abr. al 1 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	42	147	3314	3346	12	114	3067	2886	6	84	1028	2103
Intragrupa y off-shore***	0	0	2149	1351	0	0	1737	1161	0	0	1396	287
Otros	147	42	650	1417	114	12	527	1284	84	6	407	440
Total	189	189	6113	6113	126	126	5331	5331	90	90	2830	2830

* 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.