

Fecha de Publicación: 16 de abril de 2015

Fecha de Información: 14 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\$1,551 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.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	395.8	222.8	187.5	339.8	26.3	47.0	9.0
15-35	320.3	441.6	337.6	83.5	30.0	162.8	74.0
36-60	45.5	79.6	0.0	0.0	79.6	45.5	0.0
61-90	5.2	3.3	0.0	0.8	3.3	4.4	0.0
91-180	64.4	16.3	0.0	0.2	16.3	64.2	0.0
>180	36.5	12.5	0.0	0.0	2.5	26.5	10.0
Total	867.6	776.1	525.1	424.3	158.1	350.4	93.0

* 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	0.0 %	4.0 %	2.8 %	3.2 %
15-35	4.6 %	5.2 %	4.6 %	4.9 %
36-60	-	4.9 %	4.1 %	4.6 %
61-90	-	5.2 %	4.1 %	4.6 %
91-180	-	4.6 %	3.7 %	3.9 %
>180	2.0 %	4.5 %	3.8 %	3.4 %
Total	3.9 %	4.8 %	3.6 %	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

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**	46	146	3618	3379	13	114	3136	3063	6	84	1082	2146
Intragrupa y off-shore***	0	0	2174	1632	0	0	1900	1220	0	0	1398	287
Otros	146	46	650	1430	114	13	542	1295	84	6	418	465
Total	192	192	6441	6441	127	127	5578	5578	90	90	2898	2898

* 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.