

Fecha de Publicación: 17 de abril de 2015

Fecha de Información: 15 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\$1884.4 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	565.6	284.3	136.0	381.5	75.3	111.1	73.0
15-35	430.5	459.5	417.5	192.8	9.5	205.3	32.5
36-60	23.0	59.7	0.0	0.0	59.7	23.0	0.0
61-90	17.2	22.9	0.0	0.0	22.9	17.2	0.0
91-180	66.6	19.0	10.0	6.0	9.0	60.6	0.0
>180	15.9	25.7	0.0	10.0	25.7	5.9	0.0
Total	1118.9	871.0	563.5	590.3	202.0	423.1	105.5

* 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	4.0 %	4.1 %	3.2 %	3.6 %
15-35	4.8 %	4.9 %	4.5 %	4.7 %
36-60	-	4.9 %	4.3 %	4.7 %
61-90	-	4.7 %	4.0 %	4.4 %
91-180	-	3.8 %	3.9 %	3.9 %
>180	-	4.4 %	4.1 %	4.3 %
Total	4.3 %	4.6 %	3.8 %	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	147	3931	3430	13	117	3341	3221	6	85	1134	2217
Intragrupa y off-shore***	0	0	2216	1924	0	0	1994	1310	0	0	1398	287
Otros	147	46	648	1442	117	13	584	1387	85	6	448	476
Total	193	193	6795	6795	129	129	5918	5918	91	91	2980	2980

* 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.