

Fecha de Publicación: 20 de abril de 2015

Fecha de Información: 16 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\$1653.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.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	391.6	220.6	13.5	265.6	130.1	49.0	77.0
15-35	362.3	500.6	325.5	115.9	47.6	118.8	127.5
36-60	152.6	28.7	0.0	0.0	28.7	152.6	0.0
61-90	5.0	59.4	0.3	0.0	54.0	0.0	5.0
91-180	41.1	39.0	0.0	0.0	39.0	41.1	0.0
>180	35.5	43.1	0.0	15.0	26.1	3.5	17.0
Total	988.2	891.4	339.3	396.5	325.5	365.2	226.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.6 %	5.0 %	3.9 %	4.4 %
15-35	4.8 %	5.1 %	4.6 %	4.9 %
36-60	-	5.1 %	4.4 %	4.5 %
61-90	3.9 %	4.7 %	3.0 %	4.6 %
91-180	-	4.5 %	4.0 %	4.3 %
>180	4.1 %	4.3 %	4.1 %	4.2 %
Total	4.7 %	5.0 %	4.2 %	4.6 %

*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**	47	149	3938	3432	15	120	3631	3375	6	90	1226	2272
Intragruppo y off-shore***	0	0	2216	1932	0	0	2004	1535	0	0	1401	319
Otros	149	47	650	1441	120	15	689	1413	90	6	461	497
Total	196	196	6804	6804	135	135	6324	6324	96	96	3088	3088

* 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.