

Fecha de Publicación: 21 de abril de 2015

Fecha de Información: 17 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\$826.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.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	219.0	85.8	30.0	166.0	25.8	23.0	30.0
15-35	285.1	175.2	130.0	105.8	18.2	152.3	27.0
36-60	12.8	13.4	0.0	0.0	3.4	2.8	10.0
61-90	17.6	36.6	13.1	0.0	8.5	2.6	15.0
91-180	3.4	30.7	0.0	0.0	30.7	3.4	0.0
>180	17.1	11.6	0.0	16.0	11.6	1.1	0.0
Total	554.9	353.3	173.1	287.8	98.2	185.1	82.0

* 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	4.2 %	4.8 %	4.0 %	4.3 %
15-35	4.5 %	4.8 %	3.6 %	4.0 %
36-60	4.3 %	5.1 %	3.8 %	4.4 %
61-90	4.5 %	4.6 %	3.5 %	4.4 %
91-180	-	4.4 %	3.7 %	4.3 %
>180	-	4.4 %	4.1 %	4.2 %
Total	4.4 %	4.7 %	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**	47	148	3938	3432	14	127	3828	3415	6	91	1248	2306
Intragruppo y off-shore***	0	0	2216	1932	0	0	2026	1701	0	0	1409	319
Otros	148	47	650	1441	127	14	692	1429	91	6	472	504
Total	195	195	6804	6804	142	142	6545	6545	97	97	3129	3129

* 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.