

Fecha de Publicación: 24 de abril de 2015

Fecha de Información: 22 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\$1847.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.6%.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	466.8	290.0	209.9	374.2	24.1	36.6	56.0
15-35	382.4	343.7	202.5	92.8	39.2	187.6	102.0
36-60	231.8	11.8	10.0	55.0	1.7	176.8	0.0
61-90	29.4	70.4	32.6	0.0	17.8	9.4	20.0
91-180	74.4	82.3	0.1	0.0	72.2	64.4	10.0
>180	29.1	26.1	21.2	13.0	1.9	13.1	3.0
Total	1214.0	824.2	476.3	535.0	156.8	488.0	191.0

* 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	1.8 %	3.0 %	2.4 %	2.5 %
15-35	3.8 %	4.2 %	4.0 %	4.0 %
36-60	-	5.2 %	4.1 %	4.1 %
61-90	4.3 %	4.7 %	4.0 %	4.4 %
91-180	4.1 %	4.3 %	3.8 %	4.1 %
>180	4.1 %	5.0 %	3.9 %	4.0 %
Total	3.3 %	3.8 %	3.5 %	3.6 %

*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	20 al 24 de abril				27 de abr. al 1 de mayo				4 al 8 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	119	4567	3863	7	89	1605	2489	10	72	2283	2040
Intragruppo y off-shore***	0	0	2301	2262	0	0	1529	555	0	0	1337	1058
Otros	119	15	717	1460	89	7	498	587	72	10	407	929
Total	134	134	7584	7584	95	95	3632	3632	82	82	4027	4027

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.