

Fecha de Publicación: 27 de abril de 2015

Fecha de Información: 23 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\$1392.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.3%.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 | 261.3 | 215.0 | 40.0 | 183.8 | 115.0 | 17.6 | 60.0 |
| 15-35 | 572.9 | 296.2 | 151.8 | 240.8 | 59.9 | 247.7 | 84.5 |
| 36-60 | 4.9 | 13.7 | 0.0 | 0.0 | 13.7 | 4.9 | 0.0 |
| 61-90 | 0.5 | 16.7 | 0.0 | 0.0 | 16.7 | 0.5 | 0.0 |
| 91-180 | 46.5 | 89.9 | 30.0 | 0.0 | 39.9 | 26.5 | 20.0 |
| >180 | 26.6 | 28.6 | 0.0 | 0.0 | 12.6 | 10.6 | 16.0 |
| Total | 912.7 | 660.0 | 221.8 | 424.5 | 257.8 | 307.7 | 180.5 |

* 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 | 4.1 % | 6.5 % | 2.4 % | 4.5 % |
| 15-35 | 3.8 % | 4.7 % | 4.2 % | 4.3 % |
| 36-60 | - | 4.7 % | 3.8 % | 4.4 % |
| 61-90 | - | 4.4 % | 3.8 % | 4.4 % |
| 91-180 | 4.0 % | 4.3 % | 4.0 % | 4.2 % |
| >180 | 4.0 % | 4.3 % | 3.8 % | 4.0 % |
| Total | 3.9 % | 5.2 % | 3.8 % | 4.3 % |

*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 | 120 | 4721 | 3866 | 7 | 96 | 1651 | 2538 | 10 | 91 | 2346 | 2201 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2301 | 2410 | 0 | 0 | 1564 | 589 | 0 | 0 | 1363 | 1060 |
| Otros | 120 | 15 | 720 | 1466 | 96 | 7 | 511 | 599 | 91 | 10 | 482 | 930 |
| Total | 136 | 136 | 7741 | 7741 | 103 | 103 | 3726 | 3726 | 101 | 101 | 4191 | 4191 |

* 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.