

Fecha de Publicación: 28 de abril de 2015

Fecha de Información: 24 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\$1289.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	310.8	200.8	166.0	267.3	14.8	23.6	20.0
15-35	423.8	427.7	120.0	93.5	32.7	55.3	275.0
36-60	99.4	13.7	0.0	0.0	13.7	99.4	0.0
61-90	5.3	28.6	0.0	0.0	28.6	5.3	0.0
91-180	29.4	16.2	0.0	10.0	16.2	19.4	0.0
>180	2.0	26.3	10.0	0.0	16.3	2.0	0.0
Total	870.8	713.4	296.0	370.8	122.4	205.0	295.0

* 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	3.7 %	3.1 %	2.9 %	3.0 %
15-35	3.3 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	4.7 %	3.5 %	3.6 %
61-90	-	4.4 %	3.6 %	4.3 %
91-180	-	4.6 %	2.5 %	3.2 %
>180	-	3.7 %	3.9 %	3.7 %
Total	3.3 %	3.5 %	3.1 %	3.3 %

*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	118	4721	3867	8	99	1822	2598	10	93	2485	2337
Intragruppo y off-shore***	0	0	2301	2410	0	0	1594	730	0	0	1499	1187
Otros	118	15	721	1466	99	8	522	610	93	10	482	942
Total	133	133	7742	7742	107	107	3937	3937	103	103	4466	4466

* 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.