

Fecha de Publicación: 30 de abril de 2015

Fecha de Información: 28 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\$1914.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	347.1	118.4	28.0	230.2	45.4	71.8	45.0
15-35	351.8	795.8	539.9	51.5	79.9	124.3	176.0
36-60	223.0	20.8	1.9	30.0	17.0	191.1	1.9
61-90	2.3	16.2	0.7	0.0	15.5	2.3	0.0
91-180	188.7	142.1	0.0	0.0	27.1	73.7	115.0
>180	4.0	41.8	10.0	0.0	31.8	4.0	0.0
Total	1116.8	1135.1	580.5	311.7	216.7	467.2	337.9

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.7 %	3.2 %	1.4 %	1.9 %
15-35	2.7 %	4.2 %	4.3 %	3.9 %
36-60	2.5 %	3.4 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	3.7 %	2.3 %	3.5 %
91-180	3.5 %	4.0 %	2.3 %	3.2 %
>180	-	3.8 %	2.7 %	3.7 %
Total	3.0 %	4.0 %	2.3 %	3.1 %

*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	27 de abr. al 1 de mayo				4 al 8 de mayo				11 al 15 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	96	2492	2684	20	94	2593	2481	21	95	2668	3087
Intragrupa y off-shore***	0	0	1606	1313	0	0	1586	1241	0	0	2125	898
Otros	96	8	546	646	94	20	513	969	95	21	534	1343
Total	104	104	4643	4643	114	114	4692	4692	116	116	5328	5328

* 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 intragrupo.