

Fecha de Publicación: 5 de mayo de 2015

Fecha de Información: 30 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\$1419.4 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	204.9	149.2	55.5	80.5	8.7	39.4	85.0
15-35	380.2	527.4	271.5	141.0	98.9	82.2	157.0
36-60	45.4	15.8	0.0	0.0	15.8	45.4	0.0
61-90	132.8	76.3	0.0	0.0	6.3	62.8	70.0
91-180	76.5	122.0	35.0	0.0	77.0	66.5	10.0
>180	1.2	9.6	0.1	0.0	9.5	1.2	0.0
Total	841.1	900.3	362.1	221.5	216.2	297.6	322.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.2 %	2.7 %	2.3 %	2.3 %
15-35	3.3 %	3.0 %	3.0 %	3.1 %
36-60	-	3.9 %	3.0 %	3.3 %
61-90	3.3 %	4.2 %	3.1 %	3.3 %
91-180	3.3 %	4.0 %	3.2 %	3.7 %
>180	-	4.3 %	3.6 %	4.2 %
Total	3.0 %	3.3 %	2.9 %	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**	7	74	2521	2686	22	96	2997	2738	24	97	2848	3233
Intragrupa y off-shore***	0	0	1608	1326	0	0	1685	1472	0	0	2134	923
Otros	74	7	546	663	96	22	545	1017	97	24	572	1398
Total	82	82	4675	4675	118	118	5227	5227	121	121	5553	5553

* 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 intragrupo.