

Fecha de Publicación: 6 de mayo de 2015

Fecha de Información: 04 de mayo 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\$989.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.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	161.4	161.6	95.0	72.5	26.6	48.9	40.0
15-35	282.9	274.3	114.3	87.5	21.0	56.4	139.0
36-60	96.7	67.6	0.0	1.1	67.6	95.6	0.0
61-90	0.0	6.7	0.0	0.0	6.7	0.0	0.0
91-180	69.3	16.2	0.0	0.0	16.2	69.3	0.0
>180	28.7	3.2	0.0	0.0	3.2	28.7	0.0
Total	639.1	529.7	209.3	161.1	141.3	299.0	179.0

* 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	2.7 %	3.3 %	2.8 %	3.0 %
15-35	2.6 %	3.3 %	2.7 %	2.8 %
36-60	-	3.6 %	2.9 %	3.2 %
61-90	-	3.6 %	2.6 %	3.6 %
91-180	-	4.0 %	3.1 %	3.2 %
>180	-	4.4 %	3.6 %	3.7 %
Total	2.6 %	3.4 %	2.9 %	3.0 %

*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	4 al 8 de mayo				11 al 15 de mayo				18 al 22 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	94	3079	2825	27	100	2923	3300	29	121	2307	2164
Intragrupa y off-shore***	0	0	1745	1520	0	0	2165	947	25	0	1147	633
Otros	94	25	552	1031	100	27	588	1428	97	29	313	970
Total	119	119	5376	5376	127	127	5676	5676	151	151	3767	3767

* 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.