

Fecha de Publicación: 8 de mayo de 2015

Fecha de Información: 06 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\$1778.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	451.2	166.4	38.0	383.8	83.4	22.4	45.0
15-35	474.7	571.7	345.1	191.0	42.6	99.7	184.0
36-60	148.0	36.6	0.0	0.0	36.6	148.0	0.0
61-90	11.7	15.4	0.0	10.0	15.4	1.7	0.0
91-180	0.0	58.0	0.0	0.0	58.0	0.0	0.0
>180	55.7	48.3	0.0	0.0	18.3	25.7	30.0
Total	1141.4	896.3	383.1	584.8	254.2	297.6	259.0

* 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 %	2.5 %	-4.3 %	-1.9 %
15-35	2.5 %	2.1 %	1.5 %	2.0 %
36-60	-	3.9 %	2.5 %	2.8 %
61-90	-	3.9 %	1.9 %	3.0 %
91-180	-	3.7 %	2.9 %	3.7 %
>180	3.6 %	4.0 %	3.5 %	3.7 %
Total	2.6 %	2.5 %	-0.5 %	1.2 %

* 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**	26	93	3596	2956	28	106	3048	3474	30	124	2487	2284
Intragrupa y off-shore***	0	0	1768	1925	0	0	2190	1032	25	0	1182	666
Otros	93	26	567	1050	106	28	717	1449	99	30	352	1071
Total	120	120	5930	5930	134	134	5955	5955	154	154	4021	4021

* 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.