

Fecha de Publicación: 27 de mayo de 2015

Fecha de Información: 25 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\$60.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.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	6.4	6.1	0.0	2.0	6.1	4.4	0.0
15-35	6.1	9.6	0.0	5.0	8.6	0.1	1.0
36-60	1.4	0.5	0.0	0.0	0.5	1.4	0.0
61-90	6.7	0.9	0.0	0.0	0.9	6.7	0.0
91-180	0.3	19.3	0.0	0.0	19.3	0.3	0.0
>180	2.2	1.5	0.0	0.0	1.5	2.2	0.0
Total	23.1	37.9	0.0	7.0	36.9	15.1	1.0

* 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	-	4.1 %	3.3 %	3.7 %
15-35	3.3 %	4.0 %	4.1 %	4.0 %
36-60	-	5.2 %	3.3 %	3.8 %
61-90	-	4.8 %	3.4 %	3.6 %
91-180	-	3.9 %	3.3 %	3.9 %
>180	-	3.9 %	3.5 %	3.7 %
Total	3.3 %	4.0 %	3.6 %	3.8 %

* 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	25 al 29 de mayo				1 al 5 de junio				8 al 12 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	91	2765	2747	9	76	2953	2977	16	125	2968	3740
Intragrupa y off-shore***	0	18	1373	822	0	0	1983	844	0	0	2349	629
Otros	91	18	747	1316	76	9	404	1518	125	16	621	1570
Total	127	127	4885	4885	85	85	5339	5339	141	141	5938	5938

* 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.