

Fecha de Publicación: 1 de junio de 2015

Fecha de Información: 28 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\$1082.9 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	96.2	208.3	131.5	19.0	15.8	16.2	61.0
15-35	282.9	306.9	213.0	159.0	12.9	42.9	81.0
36-60	47.9	74.2	0.0	0.0	52.2	25.9	22.0
61-90	93.6	17.9	0.0	1.8	17.9	91.8	0.0
91-180	8.2	95.1	0.0	0.0	95.1	8.2	0.0
>180	6.8	8.9	0.0	0.0	8.9	6.8	0.0
Total	535.6	711.2	344.5	179.8	202.7	191.8	164.0

* 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	3.8 %	3.7 %	2.8 %	3.6 %
15-35	3.5 %	4.4 %	3.9 %	3.9 %
36-60	3.6 %	4.1 %	3.4 %	3.8 %
61-90	-	3.7 %	3.5 %	3.5 %
91-180	-	4.2 %	3.5 %	4.1 %
>180	-	4.1 %	3.5 %	3.9 %
Total	3.6 %	4.1 %	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**	38	87	3209	3010	11	80	3134	3455	23	127	3167	4020
Intragrupa y off-shore***	0	18	1441	1093	0	0	2345	899	0	0	2503	664
Otros	87	20	806	1353	80	11	422	1548	127	23	686	1671
Total	124	124	5456	5456	91	91	5901	5901	150	150	6356	6356

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.