

Fecha de Publicación: 3 de junio de 2015

Fecha de Información: 01 de junio 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\$1681.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	205.8	251.9	240.5	175.3	5.4	24.5	6.0
15-35	531.5	404.0	333.0	203.5	24.0	281.0	47.0
36-60	91.1	7.7	0.0	0.0	7.7	91.1	0.0
61-90	13.7	5.9	0.0	0.0	5.9	13.7	0.0
91-180	73.6	127.6	60.0	0.0	67.6	73.6	0.0
>180	0.3	21.2	20.0	0.0	1.2	0.3	0.0
Total	916.1	818.3	653.5	378.8	111.8	484.3	53.0

* 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	6.7 %	3.9 %	4.4 %	4.2 %
15-35	5.3 %	4.1 %	3.7 %	4.0 %
36-60	-	4.1 %	3.5 %	3.5 %
61-90	-	4.1 %	3.5 %	3.7 %
91-180	-	3.9 %	3.5 %	3.8 %
>180	-	3.8 %	3.3 %	3.7 %
Total	5.4 %	4.0 %	3.8 %	4.0 %

* 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

Sector	1 al 5 de junio				8 al 12 de junio				15 al 19 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	81	3614	3831	24	127	3223	4188	35	93	2345	2679
Intragruppo y off-shore***	0	0	2568	1201	0	0	2642	678	0	0	1796	585
Otros	81	11	431	1581	127	24	700	1700	93	35	466	1342
Total	93	93	6613	6613	152	152	6566	6566	129	129	4606	4606

* 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.