

Fecha de Publicación: 4 de junio de 2015

Fecha de Información: 02 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\$2250.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.6%.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	403.7	168.8	90.0	237.5	33.8	121.2	45.0
15-35	847.9	917.7	537.3	222.8	51.5	296.2	329.0
36-60	58.7	28.1	20.0	15.0	8.1	43.7	0.0
61-90	0.7	22.2	0.0	0.0	22.2	0.7	0.0
91-180	47.9	106.9	90.5	0.0	14.4	45.9	2.0
>180	21.1	19.5	0.0	0.0	2.5	4.1	17.0
Total	1380.0	1263.2	737.8	475.3	132.4	511.7	393.0

* 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 %	4.0 %	2.7 %	3.2 %
15-35	4.1 %	4.0 %	3.3 %	3.8 %
36-60	-	2.6 %	3.8 %	3.4 %
61-90	-	4.3 %	3.0 %	4.2 %
91-180	3.9 %	3.4 %	3.7 %	3.5 %
>180	3.8 %	3.9 %	3.5 %	3.7 %
Total	4.1 %	3.9 %	3.2 %	3.6 %

*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**	13	80	3797	3847	78	125	3375	4288	36	93	2549	2883
Intragruppo y off-shore***	0	0	2577	1377	0	0	2688	740	0	0	1872	650
Otros	80	13	438	1589	125	78	710	1745	93	36	503	1392
Total	93	93	6812	6812	203	203	6773	6773	129	129	4925	4925

* 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.