

Fecha de Publicación: 5 de junio de 2015

Fecha de Información: 03 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\$2112.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	566.3	165.2	71.5	396.3	11.7	88.0	82.0
15-35	387.9	850.5	671.3	179.3	26.2	55.6	153.0
36-60	124.4	35.6	20.0	0.0	15.6	124.4	0.0
61-90	0.4	3.3	0.0	0.0	3.3	0.4	0.0
91-180	4.0	193.5	126.0	0.0	67.5	4.0	0.0
>180	6.1	10.6	10.0	0.0	0.6	6.1	0.0
Total	1089.0	1258.7	898.8	575.6	125.0	278.5	235.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-1.3 %	4.5 %	2.1 %	1.8 %
15-35	4.3 %	4.5 %	2.4 %	4.0 %
36-60	-	3.2 %	3.9 %	3.7 %
61-90	-	4.0 %	3.4 %	3.9 %
91-180	-	3.8 %	3.7 %	3.8 %
>180	-	3.4 %	3.3 %	3.4 %
Total	2.3 %	4.2 %	2.5 %	3.3 %

*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	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**	14	80	4166	3870	155	125	3466	4392	37	93	2607	2932
Intragruppo y off-shore***	0	0	2585	1725	0	0	2747	783	0	0	1891	675
Otros	80	14	441	1598	125	155	715	1753	93	37	503	1395
Total	94	94	7192	7192	281	281	6927	6927	130	130	5002	5002

* 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 intragruppo.