

Fecha de Publicación: 10 de junio de 2015

Fecha de Información: 05 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\$1301.8 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	359.1	197.4	58.0	183.0	54.4	91.1	85.0
15-35	282.4	540.1	372.5	54.5	19.6	79.9	148.0
36-60	26.5	52.7	30.0	0.0	22.7	26.5	0.0
61-90	5.0	23.1	10.1	0.0	13.0	5.0	0.0
91-180	18.9	4.8	0.0	0.0	4.8	18.9	0.0
>180	17.5	7.5	0.0	10.0	7.5	7.5	0.0
Total	709.4	825.5	470.6	247.5	121.9	228.9	233.0

* 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 %	4.5 %	2.6 %	3.3 %
15-35	4.1 %	4.4 %	3.9 %	4.2 %
36-60	-	4.2 %	3.7 %	4.1 %
61-90	-	4.5 %	0.3 %	3.7 %
91-180	-	5.3 %	3.6 %	4.0 %
>180	-	4.7 %	3.6 %	4.0 %
Total	4.0 %	4.4 %	3.1 %	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	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	81	4237	3903	167	123	3717	4570	87	97	2768	3127
Intragrupa y off-shore***	0	0	2599	1781	0	0	2815	934	0	0	1984	757
Otros	81	14	449	1601	123	167	745	1772	97	87	550	1419
Total	95	95	7285	7285	290	290	7277	7277	184	184	5302	5302

* 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.