

Fecha de Publicación: 11 de junio de 2015

Fecha de Información: 09 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\$1987.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.3%.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	469.5	297.3	159.5	421.0	127.8	38.4	10.0
15-35	600.0	289.8	157.5	384.3	43.8	127.2	88.5
36-60	38.1	16.1	0.0	0.0	16.1	38.1	0.0
61-90	22.0	16.0	0.0	0.0	16.0	22.0	0.0
91-180	69.0	227.7	172.0	0.0	55.7	69.0	0.0
>180	25.5	35.4	0.0	0.0	15.4	5.5	20.0
Total	1224.0	882.4	489.0	805.3	274.9	300.3	118.5

* 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 %	3.4 %	5.4 %	4.6 %
15-35	4.2 %	4.8 %	3.9 %	4.1 %
36-60	-	4.5 %	3.7 %	4.0 %
61-90	-	4.9 %	3.7 %	4.2 %
91-180	-	4.1 %	3.8 %	4.0 %
>180	3.8 %	4.1 %	3.4 %	3.9 %
Total	4.1 %	4.0 %	4.5 %	4.3 %

*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

Sector	8 al 12 de junio				15 al 19 de junio				22 al 26 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	167	124	4103	4708	91	97	2827	3243	19	88	2690	2996
Intragrupa y off-shore***	0	0	2916	1296	0	0	2025	799	0	0	1662	627
Otros	124	167	782	1797	97	91	615	1426	88	19	656	1386
Total	292	292	7801	7801	188	188	5467	5467	107	107	5008	5008

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