

Fecha de Publicación: 17 de junio de 2015

Fecha de Información: 12 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\$888.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	322.1	221.5	41.8	67.8	9.7	84.3	170.0
15-35	318.6	244.3	111.5	104.5	7.8	89.1	125.0
36-60	26.9	1.9	0.0	0.0	1.9	26.9	0.0
61-90	1.0	22.2	0.0	0.0	22.2	1.0	0.0
91-180	0.9	15.4	0.0	0.0	15.4	0.9	0.0
>180	0.8	8.2	0.0	0.0	8.2	0.8	0.0
Total	670.3	513.6	153.3	172.3	65.3	203.0	295.0

* 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	3.2 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
15-35	2.8 %	3.9 %	4.0 %	3.6 %
36-60	-	5.1 %	3.6 %	3.7 %
61-90	-	4.9 %	3.7 %	4.8 %
91-180	-	4.4 %	3.8 %	4.3 %
>180	-	3.9 %	4.2 %	3.9 %
Total	3.0 %	3.9 %	3.6 %	3.5 %

*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**	168	128	5134	4845	109	103	3261	3613	21	94	2882	3321
Intragrupa y off-shore***	0	0	2991	2253	0	0	2204	989	0	0	1870	693
Otros	128	168	776	1804	103	109	624	1487	94	21	708	1447
Total	295	295	8902	8902	211	211	6089	6089	115	115	5461	5461

* 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.