

Fecha de Publicación: 19 de junio de 2015

Fecha de Información: 17 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\$1668.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.1%.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	500.3	252.4	164.8	418.4	17.3	11.6	70.3
15-35	325.0	501.7	443.3	118.6	23.4	171.4	35.0
36-60	15.5	38.2	30.0	0.0	8.2	15.5	0.0
61-90	2.6	1.7	0.0	0.0	1.6	2.5	0.2
91-180	49.9	109.3	0.0	0.0	71.9	12.5	37.4
>180	9.0	8.4	0.0	0.0	5.4	6.0	3.0
Total	902.4	911.7	638.1	537.0	127.8	219.5	145.9

* 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	5.4 %	4.5 %	3.7 %	4.1 %
15-35	3.9 %	4.2 %	3.8 %	4.1 %
36-60	-	2.5 %	3.9 %	2.9 %
61-90	4.3 %	4.5 %	3.7 %	4.0 %
91-180	4.1 %	4.3 %	3.7 %	4.2 %
>180	3.8 %	4.3 %	3.4 %	3.8 %
Total	4.7 %	4.2 %	3.7 %	4.1 %

*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	15 al 19 de junio				22 al 26 de junio				29 de jun. al 3 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	108	108	3878	3775	21	97	3078	3592	5	54	2295	3068
Intragruppo y off-shore***	0	0	2282	1508	0	0	1976	698	0	0	1948	701
Otros	108	108	623	1499	96	21	721	1485	54	5	393	868
Total	216	216	6782	6782	118	118	5775	5775	59	59	4636	4636

* 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.