

Fecha de Publicación: 22 de junio de 2015

Fecha de Información: 18 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\$1669.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.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	299.8	276.4	193.9	226.4	25.5	16.4	57.0
15-35	611.9	400.9	279.0	147.8	46.9	389.1	75.0
36-60	32.6	13.1	0.7	0.0	12.5	32.6	0.0
61-90	0.4	26.5	0.0	0.0	26.5	0.4	0.0
91-180	1.9	103.7	11.0	0.0	92.7	1.9	0.0
>180	29.6	15.0	0.0	15.0	5.0	4.6	10.0
Total	976.1	835.7	484.5	389.2	209.2	444.9	142.0

* 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	4.3 %	4.3 %	3.5 %	3.9 %
15-35	4.2 %	4.1 %	3.8 %	4.0 %
36-60	-	4.7 %	3.8 %	4.0 %
61-90	-	4.9 %	3.1 %	4.8 %
91-180	-	4.3 %	3.5 %	4.3 %
>180	3.9 %	4.4 %	3.7 %	3.9 %
Total	4.2 %	4.3 %	3.7 %	4.0 %

*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**	94	105	4013	3776	36	97	3126	3785	5	55	2411	3150
Intragruppo y off-shore***	0	0	2282	1644	0	0	2149	733	0	0	1970	756
Otros	105	94	623	1499	97	36	735	1491	55	5	403	879
Total	199	199	6918	6918	132	132	6010	6010	60	60	4784	4784

* 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.