

Fecha de Publicación: 25 de junio de 2015

Fecha de Información: 23 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\$1629.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.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	353.5	199.8	50.0	207.5	20.8	17.0	129.0
15-35	592.4	561.3	249.5	245.0	51.8	87.4	260.0
36-60	54.5	53.9	0.0	0.0	33.9	34.5	20.0
61-90	5.3	3.1	0.0	0.0	3.1	5.3	0.0
91-180	141.8	98.9	0.0	40.0	68.9	71.8	30.0
>180	3.1	0.6	0.0	0.0	0.6	3.1	0.0
Total	1150.6	917.7	299.5	492.5	179.2	219.1	439.0

* 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	3.7 %	4.0 %	3.3 %	3.5 %
15-35	3.8 %	3.9 %	3.6 %	3.8 %
36-60	3.9 %	4.3 %	3.9 %	4.0 %
61-90	-	4.2 %	3.7 %	3.9 %
91-180	2.9 %	4.3 %	3.8 %	3.8 %
>180	-	4.8 %	3.6 %	3.8 %
Total	3.7 %	4.0 %	3.5 %	3.7 %

*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	22 al 26 de junio				29 de jun. al 3 de julio				6 al 10 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	101	3729	4187	7	54	2533	3238	13	95	2470	2691
Intragrupa y off-shore***	0	0	2323	1072	0	0	1999	796	0	0	1542	950
Otros	100	35	742	1535	54	7	414	912	95	13	698	1070
Total	136	136	6794	6794	61	61	4946	4946	108	108	4710	4710

* 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 intragrupo.