

Fecha de Publicación: 26 de junio de 2015

Fecha de Información: 24 de junio de miércoles 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\$2080.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.6%.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	625.9	351.7	115.0	365.4	17.7	41.6	219.0
15-35	534.9	600.1	473.5	165.5	14.1	256.9	112.5
36-60	38.4	6.5	0.0	0.0	6.5	38.4	0.0
61-90	25.0	39.3	21.3	10.7	8.0	4.3	10.0
91-180	29.0	121.1	50.0	0.0	71.1	29.0	0.0
>180	19.2	36.7	0.0	10.0	30.7	3.2	6.0
Total	1272.4	1155.5	659.8	551.6	148.2	373.3	347.5

* 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	2.9 %	3.7 %	2.8 %	3.0 %
15-35	3.9 %	4.3 %	3.7 %	4.0 %
36-60	-	4.0 %	3.6 %	3.7 %
61-90	3.7 %	4.2 %	3.5 %	3.8 %
91-180	-	3.7 %	3.7 %	3.7 %
>180	3.7 %	3.9 %	3.7 %	3.8 %
Total	3.3 %	4.1 %	3.4 %	3.6 %

*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**	36	83	4119	4276	11	55	2621	3346	13	96	2608	2857
Intragrupa y off-shore***	0	0	2348	1396	0	0	2070	833	0	0	1571	955
Otros	83	36	746	1542	55	11	417	930	96	13	710	1077
Total	118	118	7213	7213	66	66	5108	5108	109	109	4889	4889

* 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.