

Fecha de Publicación: 30 de junio de 2015

Fecha de Información: 25 de junio de jueves 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\$1581.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	338.0	116.8	30.0	248.5	35.8	38.5	51.0
15-35	462.2	397.0	261.5	200.5	36.5	162.7	99.0
36-60	45.1	12.1	0.0	0.5	12.1	44.6	0.0
61-90	30.5	63.8	20.0	10.0	28.8	5.5	15.0
91-180	80.2	135.3	95.0	0.0	20.3	60.2	20.0
>180	20.0	65.3	20.0	20.0	45.3	0.0	0.0
Total	975.9	790.3	426.5	479.5	178.8	311.5	185.0

* 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	2.2 %	3.6 %	3.0 %	3.0 %
15-35	2.0 %	3.5 %	2.9 %	3.0 %
36-60	-	4.3 %	3.4 %	3.6 %
61-90	3.7 %	4.1 %	3.6 %	3.9 %
91-180	3.7 %	3.3 %	3.4 %	3.4 %
>180	-	3.8 %	3.9 %	3.8 %
Total	2.4 %	3.6 %	3.1 %	3.2 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

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	83	4212	4274	11	57	2836	3417	13	96	2640	2899
Intragruppo y off-shore***	0	0	2348	1485	0	0	2085	992	0	0	1586	955
Otros	83	35	745	1544	57	11	422	935	96	13	738	1109
Total	118	118	7304	7304	68	68	5343	5343	110	110	4964	4964

* 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.