

Fecha de Publicación: 2 de julio de 2015

Fecha de Información: 30 de junio de martes 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\$2291.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.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	743.3	324.7	206.5	599.5	12.2	37.8	106.0
15-35	252.4	829.7	641.3	115.0	108.7	57.7	79.7
36-60	87.4	12.0	0.0	0.0	12.0	87.4	0.0
61-90	9.3	16.6	0.0	0.0	16.6	9.3	0.0
91-180	75.5	98.5	15.0	0.0	83.5	75.5	0.0
>180	22.2	15.2	0.0	10.0	5.2	2.2	10.0
Total	1190.0	1296.7	862.8	724.5	238.2	269.8	195.7

* 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	3.3 %	4.1 %	1.0 %	2.2 %
15-35	1.2 %	4.3 %	4.1 %	3.9 %
36-60	-	4.4 %	3.8 %	3.9 %
61-90	-	4.4 %	2.6 %	3.7 %
91-180	-	4.3 %	3.6 %	4.0 %
>180	3.7 %	4.4 %	3.6 %	3.9 %
Total	2.5 %	4.3 %	2.1 %	3.1 %

*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	29 de jun. al 3 de julio				6 al 10 de julio				13 al 17 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	59	3703	3513	24	94	2840	3222	17	113	3004	2610
Intragruppo y off-shore***	0	0	2139	1752	0	0	1815	1060	0	0	1816	636
Otros	59	11	426	1003	94	24	762	1134	113	17	256	1830
Total	70	70	6268	6268	118	118	5417	5417	130	130	5076	5076

* 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.