

Fecha de Publicación: 3 de julio de 2015

Fecha de Información: 01 de julio 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\$1755.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.6%.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	293.4	226.9	167.0	219.4	5.9	20.0	54.0
15-35	484.9	599.7	521.4	208.5	4.3	202.4	74.0
36-60	24.1	10.1	0.0	0.0	10.1	24.1	0.0
61-90	32.2	13.3	0.0	0.0	13.3	32.2	0.0
91-180	79.3	104.4	98.0	20.0	2.9	55.8	3.5
>180	16.1	2.9	0.0	0.0	2.9	16.1	0.0
Total	929.9	957.3	786.4	447.9	39.4	350.5	131.5

* 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	3.7 %	4.0 %	4.8 %	4.3 %
15-35	2.0 %	3.4 %	3.7 %	3.4 %
36-60	-	4.3 %	2.0 %	2.7 %
61-90	-	4.2 %	3.3 %	3.5 %
91-180	3.9 %	3.0 %	3.2 %	3.1 %
>180	-	4.9 %	3.1 %	3.3 %
Total	2.8 %	3.5 %	3.8 %	3.6 %

*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	60	3837	3563	24	91	2967	3334	17	114	3042	2727
Intragruppo y off-shore***	0	0	2159	1861	0	0	1921	1170	0	0	1907	637
Otros	60	11	426	997	91	24	768	1151	114	17	257	1843
Total	71	71	6422	6422	115	115	5656	5656	131	131	5206	5206

* 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.