

Fecha de Publicación: 6 de julio de 2015

Fecha de Información: 02 de julio 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\$1398.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.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	202.4	240.7	102.5	95.0	83.3	52.4	55.0
15-35	328.1	381.8	322.8	75.3	28.0	221.9	31.0
36-60	44.4	52.5	0.0	0.0	52.5	44.4	0.0
61-90	24.0	26.3	0.0	0.0	26.3	24.0	0.0
91-180	95.1	41.5	0.0	0.0	41.5	95.1	0.0
>180	41.9	26.0	5.0	0.0	1.0	21.9	20.0
Total	735.9	768.7	430.2	170.3	232.5	459.6	106.0

* 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	2.9 %	3.9 %	4.0 %	3.8 %
15-35	1.4 %	4.0 %	4.0 %	3.9 %
36-60	-	4.4 %	3.2 %	3.8 %
61-90	-	4.2 %	3.7 %	4.0 %
91-180	-	4.2 %	3.6 %	3.8 %
>180	3.7 %	3.8 %	3.8 %	3.8 %
Total	2.6 %	4.0 %	3.8 %	3.8 %

*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	3836	3563	24	91	3105	3473	19	120	3133	2904
Intragruppo y off-shore***	0	0	2159	1861	0	0	1989	1244	0	0	2005	663
Otros	60	11	426	997	91	24	809	1185	120	19	292	1863
Total	71	71	6421	6421	116	116	5902	5902	139	139	5430	5430

* 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.