

Fecha de Publicación: 8 de julio de 2015

Fecha de Información: 06 de julio de lunes 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\$1389.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.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	267.9	272.2	103.4	133.4	88.8	54.5	80.0
15-35	174.0	362.4	285.0	55.0	30.4	72.0	47.0
36-60	124.3	89.9	40.0	0.0	29.9	104.3	20.0
61-90	0.5	25.5	0.3	0.0	25.2	0.5	0.0
91-180	69.7	18.2	0.0	0.8	18.2	68.8	0.0
>180	118.0	28.9	10.0	0.0	3.9	103.0	15.0
Total	754.3	797.0	438.7	189.2	196.3	403.1	162.0

* 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	3.1 %	4.3 %	3.6 %	3.8 %
15-35	4.4 %	5.0 %	3.7 %	4.6 %
36-60	4.0 %	3.6 %	3.5 %	3.6 %
61-90	-	4.2 %	2.7 %	4.1 %
91-180	-	4.1 %	3.7 %	3.8 %
>180	3.7 %	3.9 %	3.6 %	3.6 %
Total	3.7 %	4.5 %	3.6 %	4.0 %

* 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	6 al 10 de julio				13 al 17 de julio				20 al 24 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	90	3394	3716	20	121	3289	3128	22	137	2028	2115
Intragruppo y off-shore***	0	0	2132	1389	0	0	2060	709	0	0	1256	527
Otros	90	25	817	1238	121	20	384	1896	137	22	318	959
Total	115	115	6343	6343	141	141	5733	5733	159	159	3602	3602

* 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.