

Fecha de Publicación: 9 de julio de 2015

Fecha de Información: 07 de julio 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\$1684.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.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	324.6	215.0	82.2	222.0	57.8	27.6	75.0
15-35	441.5	428.5	347.5	192.5	6.0	174.0	75.0
36-60	51.4	111.3	110.0	0.0	1.3	51.4	0.0
61-90	27.5	0.3	0.0	0.0	0.3	27.5	0.0
91-180	44.7	131.0	50.0	0.0	81.0	44.7	0.0
>180	53.8	4.7	0.0	0.0	4.7	53.8	0.0
Total	943.5	890.9	589.7	414.5	151.2	379.0	150.0

* 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 %	4.3 %	2.5 %	3.0 %
15-35	4.3 %	4.5 %	4.0 %	4.3 %
36-60	-	2.2 %	3.9 %	2.7 %
61-90	-	5.4 %	3.8 %	3.8 %
91-180	-	3.9 %	3.6 %	3.8 %
>180	-	4.2 %	3.6 %	3.6 %
Total	3.3 %	4.0 %	3.5 %	3.7 %

*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	92	3660	3844	20	122	3344	3211	22	137	2051	2160
Intragruppo y off-shore***	0	0	2178	1579	0	0	2097	741	0	0	1278	527
Otros	92	25	830	1246	122	20	425	1912	137	22	320	962
Total	117	117	6668	6668	142	142	5865	5865	159	159	3649	3649

* 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.