

Fecha de Publicación: 13 de julio de 2015

Fecha de Información: 09 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\$1353.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.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	353.6	120.9	55.4	276.2	12.5	24.4	53.0
15-35	406.9	364.1	298.0	202.5	6.1	144.4	60.0
36-60	1.2	57.4	25.0	0.0	32.4	1.2	0.0
61-90	0.9	6.1	0.0	0.0	6.1	0.9	0.0
91-180	23.0	83.1	60.0	21.3	23.1	1.6	0.0
>180	29.6	44.9	15.0	0.0	4.9	4.6	25.0
Total	815.2	676.5	453.4	500.0	85.1	177.2	138.0

* 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	3.8 %	3.2 %	3.3 %	3.4 %
15-35	4.0 %	4.1 %	4.0 %	4.0 %
36-60	-	4.3 %	3.4 %	4.3 %
61-90	-	5.0 %	3.9 %	4.8 %
91-180	-	3.5 %	3.5 %	3.5 %
>180	3.8 %	3.6 %	3.3 %	3.7 %
Total	3.9 %	3.9 %	3.6 %	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	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**	29	97	4096	3944	22	126	3646	3356	21	137	2121	2271
Intragruppo y off-shore***	0	0	2200	1961	0	0	2187	970	0	0	1373	553
Otros	97	29	874	1266	125	22	430	1937	137	21	337	1007
Total	125	125	7170	7170	147	147	6262	6262	159	159	3831	3831

* 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.