

Fecha de Publicación: 15 de julio de 2015

Fecha de Información: 13 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\$1569.3 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	346.1	194.9	130.5	270.5	29.4	40.7	35.0
15-35	417.4	471.7	371.8	301.0	15.0	31.4	85.0
36-60	37.1	24.4	0.4	0.0	24.0	37.1	0.0
61-90	9.3	18.3	15.0	0.0	3.3	9.3	0.0
91-180	88.7	27.1	0.0	0.0	27.1	88.7	0.0
>180	21.7	32.3	30.0	0.0	2.3	21.7	0.0
Total	920.5	768.8	547.7	571.5	101.1	229.0	120.0

* 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	3.0 %	3.7 %	2.8 %	3.1 %
15-35	3.8 %	4.1 %	3.6 %	3.9 %
36-60	-	4.1 %	3.8 %	3.9 %
61-90	-	3.9 %	3.7 %	3.8 %
91-180	-	4.2 %	3.6 %	3.8 %
>180	-	3.7 %	3.5 %	3.6 %
Total	3.6 %	4.0 %	3.3 %	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	13 al 17 de julio				20 al 24 de julio				27 al 31 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	130	4074	3644	24	139	2303	2381	6	102	1827	2304
Intragruppo y off-shore***	0	0	2367	1286	0	0	1448	701	0	0	1448	505
Otros	130	30	453	1964	139	24	361	1030	102	6	478	944
Total	160	160	6894	6894	163	163	4112	4112	109	109	3753	3753

* 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.