

Fecha de Publicación: 17 de julio de 2015

Fecha de Información: 15 de julio de miércoles 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\$2424.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.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	509.2	268.5	148.1	343.5	22.5	67.7	98.0
15-35	672.5	773.0	643.9	236.0	23.1	330.5	106.0
36-60	21.7	3.4	0.0	0.0	3.4	21.7	0.0
61-90	5.3	69.2	25.4	0.0	43.8	5.3	0.0
91-180	112.0	123.0	105.4	2.3	5.4	97.5	12.3
>180	67.4	40.2	0.0	0.0	15.2	42.4	25.0
Total	1388.2	1277.4	922.8	581.8	113.4	565.2	241.3

* 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	3.2 %	3.3 %	2.5 %	2.7 %
15-35	3.9 %	3.8 %	3.5 %	3.7 %
36-60	-	4.1 %	3.4 %	3.5 %
61-90	-	3.4 %	3.0 %	3.4 %
91-180	0.7 %	3.4 %	3.5 %	3.3 %
>180	3.6 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
Total	3.4 %	3.7 %	3.1 %	3.4 %

* 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	134	4597	3775	29	137	2490	2633	9	103	2048	2513
Intragruppo y off-shore***	0	0	2430	1732	0	0	1574	748	0	0	1527	550
Otros	133	30	456	1976	137	29	381	1064	103	9	492	1004
Total	163	163	7483	7483	166	166	4444	4444	111	111	4067	4067

* 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.