

Fecha de Publicación: 21 de julio de 2015

Fecha de Información: 16 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\$2205.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.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	427.6	254.5	117.5	275.2	32.0	47.4	105.0
15-35	559.6	696.1	494.5	219.0	15.6	154.6	186.0
36-60	252.3	25.3	20.0	10.0	5.3	242.3	0.0
61-90	53.0	6.1	0.0	0.0	6.1	53.0	0.0
91-180	42.0	124.4	110.0	10.0	14.4	32.0	0.0
>180	10.7	44.6	38.0	0.0	6.6	10.7	0.0
Total	1345.2	1151.0	780.0	514.2	80.0	540.0	291.0

* 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	5.5 %	3.9 %	3.2 %	3.8 %
15-35	4.0 %	3.9 %	3.9 %	3.9 %
36-60	-	4.1 %	3.8 %	3.8 %
61-90	-	4.6 %	3.7 %	3.8 %
91-180	-	3.7 %	3.6 %	3.7 %
>180	-	3.6 %	3.4 %	3.6 %
Total	4.5 %	3.9 %	3.6 %	3.9 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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	C	V						
Sector Financiero**	30	120	4843	3835	30	138	2591	2765	9	102	2143	2617								
Intragrupa y off-shore***	0	0	2480	1969	0	0	1606	768	0	0	1587	568								
Otros	120	30	457	1976	138	30	404	1068	102	9	502	1047								
Total	150	150	7780	7780	168	168	4601	4601	110	110	4233	4233								

* 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.

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.