

Fecha de Publicación: 24 de julio de 2015

Fecha de Información: 22 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\$2083.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.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	664.3	363.2	131.5	445.8	33.7	20.5	198.0
15-35	400.7	684.5	535.0	68.0	32.5	215.7	117.0
36-60	30.4	25.1	11.8	0.0	13.4	30.4	0.0
61-90	2.1	11.8	0.0	0.0	11.8	2.1	0.0
91-180	122.0	15.1	0.0	0.5	15.1	121.5	0.0
>180	42.0	58.7	0.0	10.0	36.7	10.0	22.0
Total	1261.5	1158.5	678.3	524.3	143.2	400.3	337.0

* 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 %	4.3 %	2.5 %	3.0 %
15-35	3.9 %	4.3 %	3.9 %	4.2 %
36-60	-	4.5 %	3.7 %	4.1 %
61-90	-	4.5 %	1.7 %	4.1 %
91-180	-	4.2 %	3.6 %	3.6 %
>180	3.6 %	3.9 %	3.3 %	3.6 %
Total	3.8 %	4.3 %	3.1 %	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	20 al 24 de julio				27 al 31 de julio				3 al 7 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	142	3451	3140	13	106	2439	3140	8	77	2295	2939
Intragruppo y off-shore***	0	0	1747	1425	0	0	1726	618	0	0	2089	903
Otros	142	27	465	1098	106	13	696	1103	77	8	381	922
Total	169	169	5663	5663	119	119	4861	4861	85	85	4765	4765

* 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.