

Fecha de Publicación: 27 de julio de 2015

Fecha de Información: 23 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\$1909.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.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	452.3	234.8	103.9	281.0	14.9	55.3	116.0
15-35	634.2	315.1	150.5	191.3	33.8	312.2	130.8
36-60	50.0	55.0	45.0	0.0	10.0	50.0	0.0
61-90	15.6	68.4	57.0	0.0	11.4	15.6	0.0
91-180	147.2	136.4	105.0	0.0	21.4	137.2	10.0
>180	46.9	19.9	0.0	0.0	9.9	36.9	10.0
Total	1346.1	829.6	461.5	472.3	101.4	607.1	266.8

* 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	3.5 %	4.1 %	3.4 %	3.6 %
15-35	3.9 %	4.3 %	3.8 %	3.9 %
36-60	-	4.0 %	3.6 %	3.8 %
61-90	-	3.8 %	3.5 %	3.7 %
91-180	3.6 %	3.7 %	3.6 %	3.6 %
>180	3.5 %	3.8 %	3.3 %	3.4 %
Total	3.7 %	4.0 %	3.6 %	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	124	3567	3175	13	110	2618	3266	8	79	2451	3008
Intragruppo y off-shore***	0	0	1747	1506	0	0	1814	758	0	0	2105	963
Otros	124	27	465	1097	110	13	700	1108	79	8	388	973
Total	151	151	5778	5778	123	123	5132	5132	88	88	4944	4944

* 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.