

Fecha de Publicación: 30 de julio de 2015

Fecha de Información: 28 de julio de martes 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\$2155.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.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	636.2	250.7	78.0	434.0	53.7	83.2	119.0
15-35	514.4	666.3	418.2	291.5	145.3	120.0	102.9
36-60	36.1	40.5	0.0	0.0	40.5	36.1	0.0
61-90	0.4	35.4	10.0	0.0	25.4	0.4	0.0
91-180	73.3	69.4	25.0	5.0	34.4	58.3	10.0
>180	21.5	58.6	40.0	0.0	3.6	6.5	15.0
Total	1281.8	1121.0	571.2	730.5	302.9	304.4	246.9

* 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	2.3 %	3.0 %	1.9 %	2.1 %
15-35	2.9 %	3.1 %	2.9 %	3.0 %
36-60	-	3.8 %	3.3 %	3.6 %
61-90	-	3.6 %	2.3 %	3.6 %
91-180	3.1 %	3.4 %	3.0 %	3.1 %
>180	3.3 %	3.5 %	3.1 %	3.4 %
Total	2.6 %	3.2 %	2.4 %	2.7 %

* 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	27 al 31 de julio				3 al 7 de agosto				10 al 14 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	96	3814	3812	9	81	2820	3310	13	100	3172	3285
Intragrupa y off-shore***	0	0	2092	1739	0	0	2149	1145	0	0	2105	853
Otros	96	14	793	1149	81	9	543	1057	100	13	437	1575
Total	110	110	6699	6699	90	90	5512	5512	113	113	5714	5714

* 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.