

Fecha de Publicación: 31 de julio de 2015

Fecha de Información: 29 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\$1872.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	436.2	175.3	89.5	323.5	33.8	60.8	51.9
15-35	591.8	604.9	218.5	266.8	159.4	98.1	226.9
36-60	16.8	50.3	36.0	0.0	14.3	16.8	0.0
61-90	40.5	51.0	15.0	0.0	16.0	20.5	20.0
91-180	51.8	149.9	21.8	0.0	98.1	21.8	30.0
>180	6.5	26.5	20.0	0.0	6.5	6.5	0.0
Total	1143.6	1057.8	400.8	590.3	328.2	224.5	328.9

* 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	1.8 %	2.4 %	2.1 %	2.1 %
15-35	1.6 %	2.8 %	2.0 %	2.2 %
36-60	-	2.5 %	2.6 %	2.5 %
61-90	2.7 %	3.3 %	2.5 %	2.9 %
91-180	3.1 %	3.5 %	3.0 %	3.3 %
>180	-	3.0 %	3.0 %	3.0 %
Total	1.8 %	2.9 %	2.1 %	2.3 %

* 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	91	3969	3860	13	84	3040	3394	18	102	3254	3382
Intragruppo y off-shore***	0	0	2132	1892	0	0	2166	1299	0	0	2173	869
Otros	91	14	798	1148	84	13	560	1074	102	18	446	1622
Total	105	105	6899	6899	98	98	5767	5767	120	120	5873	5873

* 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.