

Fecha de Publicación: 3 de agosto de 2015

Fecha de Información: 30 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\$1760.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	465.1	212.6	31.0	191.4	40.6	132.7	141.0
15-35	532.2	435.1	250.4	304.8	29.7	72.4	155.0
36-60	18.4	9.2	0.0	0.0	9.2	18.4	0.0
61-90	12.0	10.6	0.0	0.0	10.6	12.0	0.0
91-180	107.1	200.3	165.0	10.0	15.3	77.1	20.0
>180	59.3	49.1	10.0	0.0	4.1	24.3	35.0
Total	1194.1	917.0	456.4	506.2	109.6	336.8	351.0

* 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	1.5 %	1.9 %	1.8 %	1.7 %
15-35	0.8 %	2.4 %	2.1 %	1.9 %
36-60	-	3.2 %	2.4 %	2.7 %
61-90	-	3.5 %	2.0 %	2.7 %
91-180	3.0 %	2.7 %	2.4 %	2.6 %
>180	3.2 %	3.1 %	2.7 %	3.0 %
Total	1.4 %	2.5 %	2.0 %	2.0 %

* 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**	13	90	4044	3876	17	84	3262	3515	20	102	3425	3483
Intragruppo y off-shore***	0	0	2132	1966	0	0	2172	1398	0	0	2198	887
Otros	90	13	814	1149	84	17	560	1081	102	20	485	1738
Total	104	104	6990	6990	101	101	5994	5994	121	121	6109	6109

* 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.