

Fecha de Publicación: 16 de julio de 2015

Fecha de Información: 14 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\$1768.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	328.3	269.3	99.4	148.9	10.9	20.4	159.0
15-35	392.4	530.8	325.4	161.0	41.4	67.4	164.0
36-60	260.5	7.2	4.0	0.0	3.2	260.5	0.0
61-90	30.4	48.2	0.0	0.0	18.2	0.4	30.0
91-180	120.2	71.9	60.0	0.0	11.9	120.2	0.0
>180	25.9	50.9	27.2	0.0	8.8	10.9	15.0
Total	1157.7	978.4	516.0	309.9	94.4	479.8	368.0

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	2.9 %	3.4 %	2.1 %	2.7 %
15-35	3.6 %	3.9 %	3.5 %	3.7 %
36-60	-	4.2 %	3.7 %	3.7 %
61-90	3.6 %	3.9 %	3.3 %	3.7 %
91-180	-	4.0 %	3.6 %	3.7 %
>180	3.7 %	3.7 %	3.6 %	3.7 %
Total	3.3 %	3.8 %	3.3 %	3.5 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{360/\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	13 al 17 de julio				20 al 24 de julio				27 al 31 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	130	4269	3748	28	140	2380	2464	6	103	1931	2419
Intragrupo y off-shore***	0	0	2403	1419	0	0	1479	718	0	0	1481	525
Otros	129	30	456	1961	140	28	365	1042	102	6	485	953
Total	160	160	7128	7128	167	167	4224	4224	109	109	3897	3897

* 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.