

Fecha de Publicación: 14 de julio de 2015

Fecha de Información: 10 de julio de viernes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1280.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.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	263.2	128.6	50.5	174.0	18.1	29.2	60.0
15-35	381.6	411.2	328.5	76.2	15.7	238.4	67.0
36-60	13.7	1.6	0.0	0.0	1.6	13.7	0.0
61-90	11.5	18.7	10.0	0.0	8.7	11.5	0.0
91-180	0.4	69.6	40.0	0.0	29.6	0.4	0.0
>180	7.3	100.3	0.0	0.0	100.3	7.3	0.0
Total	677.7	730.0	429.0	250.2	174.0	300.5	127.0

* 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	17.6 %	3.7 %	2.6 %	5.6 %
15-35	3.7 %	3.7 %	3.7 %	3.7 %
36-60	-	4.5 %	3.9 %	3.9 %
61-90	-	4.0 %	3.5 %	3.8 %
91-180	-	3.8 %	2.6 %	3.8 %
>180	-	4.4 %	3.6 %	4.3 %
Total	10.2 %	3.8 %	3.3 %	4.2 %

*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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	6 al 10 de julio				13 al 17 de julio				20 al 24 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	97	4094	3944	28	127	3773	3496	22	137	2250	2314
Intragrupo y off-shore***	0	0	2200	1961	0	0	2253	1022	0	0	1412	675
Otros	97	28	874	1264	127	28	445	1952	137	22	340	1014
Total	125	125	7168	7168	155	155	6470	6470	159	159	4003	4003

* 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.