

Fecha de Publicación: 23 de julio de 2015

Fecha de Información: 21 de julio de martes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1345.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.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	343.2	184.4	69.0	213.5	41.4	55.7	74.0
15-35	336.1	335.1	250.0	196.9	24.1	78.2	61.0
36-60	38.4	77.0	35.1	0.0	41.9	38.4	0.0
61-90	9.1	14.8	0.1	0.0	14.7	9.1	0.0
91-180	48.4	91.0	35.0	0.0	38.5	30.9	17.5
>180	12.6	20.2	0.0	0.0	8.2	0.6	12.0
Total	787.8	722.4	389.1	410.4	168.8	212.9	164.5

* 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	3.8 %	5.2 %	3.2 %	3.8 %
15-35	4.2 %	4.1 %	3.8 %	4.0 %
36-60	-	4.1 %	3.7 %	4.0 %
61-90	-	4.2 %	3.7 %	4.0 %
91-180	3.8 %	3.6 %	3.5 %	3.6 %
>180	3.6 %	4.1 %	3.3 %	3.8 %
Total	3.9 %	4.3 %	3.5 %	3.9 %

*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	20 al 24 de julio				27 al 31 de julio				3 al 7 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	139	3008	3078	13	105	2302	2908	8	76	2212	2872
Intragrupo y off-shore***	0	0	1726	1022	0	0	1625	594	0	0	2079	885
Otros	139	26	464	1098	104	13	667	1094	76	8	378	913
Total	165	165	5197	5197	118	118	4595	4595	84	84	4669	4669

* 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.