

Fecha de Publicación: 29 de julio de 2015

Fecha de Información: 27 de julio de lunes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1827.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	522.0	406.4	211.3	414.4	113.1	25.6	82.0
15-35	334.0	382.7	188.5	168.0	118.7	90.5	75.5
36-60	54.5	48.3	20.0	0.0	13.3	39.5	15.0
61-90	58.0	16.4	0.0	0.0	16.4	58.0	0.0
91-180	68.1	52.5	10.1	0.0	42.4	68.1	0.0
>180	15.3	42.0	7.0	0.0	35.0	15.3	0.0
Total	1052.0	948.3	436.9	582.4	338.9	297.1	172.5

* 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 intragrupo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	3.0 %	2.9 %	2.9 %	2.9 %
15-35	3.5 %	3.6 %	2.5 %	3.2 %
36-60	3.4 %	2.8 %	3.3 %	3.1 %
61-90	-	4.2 %	3.3 %	3.5 %
91-180	-	3.5 %	3.2 %	3.4 %
>180	-	3.6 %	3.2 %	3.5 %
Total	3.3 %	3.3 %	2.8 %	3.1 %

*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 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	98	3385	3693	8	80	2629	3188	13	98	3128	3244
Intragrupo y off-shore***	0	0	2044	1387	0	0	2119	1066	0	0	2104	841
Otros	98	13	777	1126	80	8	514	1009	98	13	398	1544
Total	112	112	6206	6206	89	89	5262	5262	112	112	5629	5629

* 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.