

Fecha de Publicación: 22 de julio de 2015

Fecha de Información: 17 de julio de viernes 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\$1478.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.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	257.4	428.2	88.9	80.2	192.3	30.1	147.0
15-35	317.7	368.7	293.1	52.2	26.8	216.7	48.8
36-60	14.7	11.1	0.0	10.9	11.1	3.8	0.0
61-90	79.5	10.7	0.0	1.8	10.7	77.8	0.0
91-180	88.2	34.7	10.8	0.0	23.8	88.2	0.0
>180	54.7	33.7	0.0	0.0	8.7	29.7	25.0
Total	812.3	887.0	392.8	145.1	273.4	446.4	220.8

* 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	3.9 %	4.0 %	2.8 %	3.7 %
15-35	3.0 %	3.9 %	3.9 %	3.8 %
36-60	-	4.6 %	3.7 %	4.1 %
61-90	-	4.4 %	3.7 %	3.8 %
91-180	-	4.1 %	3.6 %	3.7 %
>180	3.5 %	3.9 %	3.4 %	3.5 %
Total	3.6 %	4.0 %	3.6 %	3.8 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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**	29	118	4843	3834	27	140	2719	2947	12	103	2271	2859
Intragrupa y off-shore***	0	0	2480	1969	0	0	1674	826	0	0	1608	591
Otros	118	29	456	1976	140	27	459	1078	103	12	636	1066
Total	148	148	7779	7779	167	167	4851	4851	115	115	4515	4515

* 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.

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.