

Fecha de Publicación: 7 de julio de 2015

Fecha de Información: 03 de julio de viernes <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$423.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	169.9	198.8	95.5	57.8	15.3	24.1	88.0
15-35	54.7	101.2	61.0	0.0	10.2	24.7	30.0
36-60	2.3	4.7	0.0	0.0	4.7	2.3	0.0
61-90	3.4	0.9	0.0	0.0	0.9	3.4	0.0
91-180	1.7	3.1	0.0	0.0	3.1	1.7	0.0
>180	0.1	0.7	0.0	0.0	0.7	0.1	0.0
<b>Total</b>	<b>232.2</b>	<b>309.4</b>	<b>156.5</b>	<b>57.8</b>	<b>34.9</b>	<b>56.5</b>	<b>118.0</b>

\* 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	3.3 %	4.4 %	3.8 %	3.9 %
15-35	4.3 %	5.1 %	2.1 %	4.2 %
36-60	-	4.4 %	3.7 %	4.2 %
61-90	-	4.2 %	3.8 %	3.9 %
91-180	-	3.9 %	3.6 %	3.8 %
>180	-	4.6 %	3.2 %	4.4 %
<b>Total</b>	<b>3.5 %</b>	<b>4.7 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>4.0 %</b>

\* Incluye solo operaciones interbancarias

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

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> 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	29 de jun. al 3 de julio				6 al 10 de julio				13 al 17 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	11	60	3836	3563	25	92	3193	3569	19	119	3213	3006
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2159	1861	0	0	2054	1288	0	0	2035	676
<b>Otros</b>	60	11	426	997	92	25	812	1201	119	19	303	1870
<b>Total</b>	<b>71</b>	<b>71</b>	<b>6421</b>	<b>6421</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>6059</b>	<b>6059</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>5552</b>	<b>5552</b>

\* 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.