

Fecha de Publicación: 10 de julio de 2015

Fecha de Información: 08 de julio de miércoles <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\$1556.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	409.3	156.1	100.5	336.0	25.6	43.3	30.0
15-35	282.4	363.7	322.5	214.9	28.2	54.5	13.0
36-60	39.9	22.9	20.0	0.0	2.9	39.9	0.0
61-90	1.6	18.9	0.0	0.0	18.9	1.6	0.0
91-180	80.7	185.4	100.0	0.2	85.4	80.5	0.0
>180	22.0	29.2	15.0	0.0	1.2	9.0	13.0
<b>Total</b>	<b>835.9</b>	<b>776.2</b>	<b>558.0</b>	<b>551.1</b>	<b>162.2</b>	<b>228.8</b>	<b>56.0</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	4.2 %	4.4 %	2.8 %	3.3 %
15-35	0.0 %	4.7 %	4.2 %	4.4 %
36-60	-	4.1 %	3.9 %	4.0 %
61-90	-	4.5 %	3.5 %	4.4 %
91-180	-	4.1 %	3.6 %	3.9 %
>180	3.6 %	3.7 %	3.6 %	3.6 %
<b>Total</b>	<b>3.1 %</b>	<b>4.4 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.9 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**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
<b>Sector Financiero**</b>	25	96	3976	3914	21	124	3449	3303	21	138	2077	2186
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2198	1852	0	0	2177	825	0	0	1293	530
<b>Otros</b>	96	25	861	1270	124	21	426	1922	138	21	332	985
<b>Total</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>7036</b>	<b>7036</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>6051</b>	<b>6051</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>3701</b>	<b>3701</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.