

Fecha de Publicación: 14 de julio de 2015

Fecha de Información: 10 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\$1280.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.<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	263.2	128.6	50.5	174.0	18.1	29.2	60.0
15-35	381.6	411.2	328.5	76.2	15.7	238.4	67.0
36-60	13.7	1.6	0.0	0.0	1.6	13.7	0.0
61-90	11.5	18.7	10.0	0.0	8.7	11.5	0.0
91-180	0.4	69.6	40.0	0.0	29.6	0.4	0.0
>180	7.3	100.3	0.0	0.0	100.3	7.3	0.0
<b>Total</b>	<b>677.7</b>	<b>730.0</b>	<b>429.0</b>	<b>250.2</b>	<b>174.0</b>	<b>300.5</b>	<b>127.0</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	17.6 %	3.7 %	2.6 %	5.6 %
15-35	3.7 %	3.7 %	3.7 %	3.7 %
36-60	-	4.5 %	3.9 %	3.9 %
61-90	-	4.0 %	3.5 %	3.8 %
91-180	-	3.8 %	2.6 %	3.8 %
>180	-	4.4 %	3.6 %	4.3 %
<b>Total</b>	<b>10.2 %</b>	<b>3.8 %</b>	<b>3.3 %</b>	<b>4.2 %</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>	28	97	4094	3944	28	127	3773	3496	22	137	2250	2314
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2200	1961	0	0	2253	1022	0	0	1412	675
<b>Otros</b>	97	28	874	1264	127	28	445	1952	137	22	340	1014
<b>Total</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>7168</b>	<b>7168</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>6470</b>	<b>6470</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>4003</b>	<b>4003</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.