

Fecha de Publicación: 28 de julio de 2015

Fecha de Información: 24 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\$1343.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.<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	432.3	194.1	32.5	321.0	84.6	34.3	77.0
15-35	253.1	303.6	189.0	158.2	64.6	45.0	50.0
36-60	13.9	54.1	40.0	0.0	14.1	13.9	0.0
61-90	43.1	16.8	0.0	1.3	16.7	41.8	0.0
91-180	5.9	83.6	0.0	1.5	83.6	4.4	0.0
>180	29.8	49.9	17.0	0.0	22.9	19.8	10.0
<b>Total</b>	<b>778.1</b>	<b>702.1</b>	<b>278.5</b>	<b>481.9</b>	<b>286.5</b>	<b>159.2</b>	<b>137.0</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 %	4.1 %	2.7 %	3.2 %
15-35	1.3 %	3.7 %	3.3 %	3.3 %
36-60	-	3.7 %	3.4 %	3.6 %
61-90	3.8 %	4.5 %	3.5 %	3.8 %
91-180	-	3.9 %	3.1 %	3.9 %
>180	3.4 %	3.4 %	3.2 %	3.4 %
<b>Total</b>	<b>2.6 %</b>	<b>3.8 %</b>	<b>3.0 %</b>	<b>3.3 %</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	20 al 24 de julio				27 al 31 de julio				3 al 7 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	28	123	3567	3175	13	112	2956	3373	8	81	2542	3092
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1747	1506	0	0	1846	1039	0	0	2105	1003
<b>Otros</b>	123	28	465	1098	112	13	727	1117	81	8	442	994
<b>Total</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>5779</b>	<b>5779</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>5529</b>	<b>5529</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>5089</b>	<b>5089</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.