

Fecha de Publicación: 29 de julio de 2015

Fecha de Información: 27 de julio de lunes <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\$1827.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.<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	522.0	406.4	211.3	414.4	113.1	25.6	82.0
15-35	334.0	382.7	188.5	168.0	118.7	90.5	75.5
36-60	54.5	48.3	20.0	0.0	13.3	39.5	15.0
61-90	58.0	16.4	0.0	0.0	16.4	58.0	0.0
91-180	68.1	52.5	10.1	0.0	42.4	68.1	0.0
>180	15.3	42.0	7.0	0.0	35.0	15.3	0.0
<b>Total</b>	<b>1052.0</b>	<b>948.3</b>	<b>436.9</b>	<b>582.4</b>	<b>338.9</b>	<b>297.1</b>	<b>172.5</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	3.0 %	2.9 %	2.9 %	2.9 %
15-35	3.5 %	3.6 %	2.5 %	3.2 %
36-60	3.4 %	2.8 %	3.3 %	3.1 %
61-90	-	4.2 %	3.3 %	3.5 %
91-180	-	3.5 %	3.2 %	3.4 %
>180	-	3.6 %	3.2 %	3.5 %
<b>Total</b>	<b>3.3 %</b>	<b>3.3 %</b>	<b>2.8 %</b>	<b>3.1 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	27 al 31 de julio				3 al 7 de agosto				10 al 14 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	13	98	3385	3693	8	80	2629	3188	13	98	3128	3244
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2044	1387	0	0	2119	1066	0	0	2104	841
<b>Otros</b>	98	13	777	1126	80	8	514	1009	98	13	398	1544
<b>Total</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>6206</b>	<b>6206</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>5262</b>	<b>5262</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>5629</b>	<b>5629</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.