

**Fecha de Publicación: 4 de agosto de 2015**

**Fecha de Información: 31 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\$1654.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<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	339.4	125.5	45.0	211.5	45.5	92.9	35.0
15-35	368.1	634.1	329.0	246.9	227.1	43.2	78.0
36-60	5.0	18.3	3.5	0.0	14.8	5.0	0.0
61-90	20.0	16.3	0.0	16.0	16.3	4.0	0.0
91-180	53.1	57.0	0.0	10.0	27.0	13.1	30.0
>180	44.5	156.5	88.0	0.0	28.5	4.5	40.0
<b>Total</b>	<b>830.1</b>	<b>1007.7</b>	<b>465.5</b>	<b>484.4</b>	<b>359.2</b>	<b>162.7</b>	<b>183.0</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	1.8 %	1.8 %	1.0 %	1.2 %
15-35	1.1 %	2.1 %	1.4 %	1.8 %
36-60	-	2.7 %	1.8 %	2.5 %
61-90	-	3.2 %	2.3 %	3.0 %
91-180	3.0 %	3.7 %	2.7 %	3.2 %
>180	3.2 %	3.2 %	1.5 %	3.2 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.9 %</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	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	90	4044	3876	18	84	3395	3568	21	107	3628	3550
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2132	1966	0	0	2172	1491	0	0	2243	1006
<b>Otros</b>	90	13	815	1149	84	18	588	1096	107	21	498	1813
<b>Total</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>6991</b>	<b>6991</b>	<b>102</b>	<b>102</b>	<b>6155</b>	<b>6155</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>6369</b>	<b>6369</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.