

Fecha de Publicación: 8 de julio de 2015

Fecha de Información: 06 de julio de lunes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1389.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|--------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 267.9 | 272.2 | 103.4 | 133.4 | 88.8 | 54.5 | 80.0 |
| 15-35 | 174.0 | 362.4 | 285.0 | 55.0 | 30.4 | 72.0 | 47.0 |
| 36-60 | 124.3 | 89.9 | 40.0 | 0.0 | 29.9 | 104.3 | 20.0 |
| 61-90 | 0.5 | 25.5 | 0.3 | 0.0 | 25.2 | 0.5 | 0.0 |
| 91-180 | 69.7 | 18.2 | 0.0 | 0.8 | 18.2 | 68.8 | 0.0 |
| >180 | 118.0 | 28.9 | 10.0 | 0.0 | 3.9 | 103.0 | 15.0 |
| Total | 754.3 | 797.0 | 438.7 | 189.2 | 196.3 | 403.1 | 162.0 |

* 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 intragruo | | Total |
|--------------|--------------------|-----------------------------|--------------|--------------|
| | | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 3.1 % | 4.3 % | 3.6 % | 3.8 % |
| 15-35 | 4.4 % | 5.0 % | 3.7 % | 4.6 % |
| 36-60 | 4.0 % | 3.6 % | 3.5 % | 3.6 % |
| 61-90 | - | 4.2 % | 2.7 % | 4.1 % |
| 91-180 | - | 4.1 % | 3.7 % | 3.8 % |
| >180 | 3.7 % | 3.9 % | 3.6 % | 3.6 % |
| Total | 3.7 % | 4.5 % | 3.6 % | 4.0 % |

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹ Datos provisionales.

² 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.

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 |
| Sector Financiero** | 25 | 90 | 3394 | 3716 | 20 | 121 | 3289 | 3128 | 22 | 137 | 2028 | 2115 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2132 | 1389 | 0 | 0 | 2060 | 709 | 0 | 0 | 1256 | 527 |
| Otros | 90 | 25 | 817 | 1238 | 121 | 20 | 384 | 1896 | 137 | 22 | 318 | 959 |
| Total | 115 | 115 | 6343 | 6343 | 141 | 141 | 5733 | 5733 | 159 | 159 | 3602 | 3602 |

* 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.