

Fecha de Publicación: 24 de marzo de 2015

Fecha de Información: 19 de marzo de 2015 <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\$1,645 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.<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	244.8	199.8	144.0	191.0	35.8	33.8	20.0
15-35	432.4	594.6	499.4	133.3	57.2	261.1	38.0
36-60	32.7	12.8	0.0	0.0	12.8	32.7	0.0
61-90	19.0	21.0	1.4	0.0	19.5	18.9	0.0
91-180	19.0	103.4	35.0	0.0	68.4	19.0	0.0
>180	1.2	22.4	12.0	0.0	10.4	1.2	0.0
<b>Total</b>	<b>749.1</b>	<b>954.0</b>	<b>691.8</b>	<b>324.3</b>	<b>204.2</b>	<b>366.8</b>	<b>58.0</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	3.8 %	4.2 %	2.4 %	3.2 %
15-35	3.8 %	4.1 %	3.3 %	3.7 %
36-60	-	4.6 %	3.6 %	3.9 %
61-90	4.1 %	4.6 %	3.7 %	4.2 %
91-180	-	4.3 %	3.8 %	4.2 %
>180	-	4.0 %	3.3 %	3.9 %
<b>Total</b>	<b>3.8 %</b>	<b>4.1 %</b>	<b>3.1 %</b>	<b>3.7 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

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

Cuadro No. 3  
Vencimientos de Forwards

Sectores	16 al 20 de marzo				23 al 27 de marzo				30 de mar. al 3 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	89	5054	4951	14	79	2422	2916	13	158	1927	2263
Intragrupa y off-shore***	3	0	3408	2526	0	0	2054	712	0	0	1334	871
Otros	86	30	459	1444	79	14	456	1304	158	13	345	472
<b>Total</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>8921</b>	<b>8921</b>	<b>93</b>	<b>93</b>	<b>4932</b>	<b>4932</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>3606</b>	<b>3606</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.

<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:  $((\text{Tasa Pactada/Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.