

Fecha de Publicación: 13 de abril de 2015

Fecha de Información: 09 de abril 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\$1,077 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.<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         | 160.3               | 176.0        | 109.0                      | 109.6        | 36.0          | 19.7         | 31.0           |
| 15-35        | 352.4               | 260.5        | 132.8                      | 155.0        | 59.7          | 129.4        | 68.0           |
| 36-60        | 46.7                | 2.6          | 0.0                        | 0.0          | 2.6           | 46.7         | 0.0            |
| 61-90        | 0.6                 | 17.0         | 0.0                        | 0.0          | 17.0          | 0.6          | 0.0            |
| 91-180       | 11.3                | 24.9         | 0.0                        | 0.0          | 24.9          | 11.3         | 0.0            |
| >180         | 32.3                | 110.9        | 70.0                       | 0.0          | 20.9          | 12.3         | 20.0           |
| <b>Total</b> | <b>603.7</b>        | <b>591.9</b> | <b>311.9</b>               | <b>264.6</b> | <b>161.1</b>  | <b>220.1</b> | <b>119.0</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 intragruppo |              | Total        |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
|              | Compras/Ventas     | Compras                       | Ventas       |              |
| 3-14         | 4.2 %              | 3.9 %                         | 2.7 %        | 3.4 %        |
| 15-35        | 4.1 %              | 3.9 %                         | 3.7 %        | 3.8 %        |
| 36-60        | -                  | 5.1 %                         | 3.8 %        | 3.9 %        |
| 61-90        | -                  | 4.2 %                         | 3.7 %        | 4.2 %        |
| 91-180       | -                  | 4.4 %                         | 3.7 %        | 4.2 %        |
| >180         | 4.0 %              | 4.1 %                         | 3.8 %        | 4.0 %        |
| <b>Total</b> | <b>4.1 %</b>       | <b>4.0 %</b>                  | <b>3.4 %</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                   | 6 al 10 de abril |            |             |             | 13 al 17 de abril |            |             |             | 20 al 24 de abril |            |             |             |
|----------------------------|------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
|                            | Delivery         |            | NDF         |             | Delivery          |            | NDF         |             | Delivery          |            | NDF         |             |
|                            | C                | V          | C           | V           | C                 | V          | C           | V           | C                 | V          | C           | V           |
| Sector Financiero**        | 36               | 97         | 4328        | 3706        | 29                | 143        | 2982        | 3023        | 11                | 114        | 2831        | 2636        |
| Intragruppo y off-shore*** | 0                | 0          | 2328        | 2022        | 0                 | 0          | 1952        | 1192        | 0                 | 0          | 1639        | 1103        |
| Otros                      | 96               | 36         | 661         | 1588        | 143               | 29         | 630         | 1350        | 114               | 11         | 491         | 1221        |
| <b>Total</b>               | <b>132</b>       | <b>133</b> | <b>7316</b> | <b>7316</b> | <b>173</b>        | <b>173</b> | <b>5564</b> | <b>5564</b> | <b>124</b>        | <b>124</b> | <b>4960</b> | <b>4960</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 intragruppo.