

Fecha de Publicación: 22 de abril de 2015

Fecha de Información: 20 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\$806.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.<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	219.8	128.5	95.5	144.0	17.0	59.8	16.0
15-35	86.5	90.0	67.8	48.0	16.2	32.5	6.0
36-60	150.2	23.1	15.0	0.0	8.1	150.2	0.0
61-90	3.1	28.9	11.2	3.0	17.7	0.2	0.0
91-180	68.6	22.6	0.0	0.0	22.6	68.6	0.0
>180	3.6	3.1	0.0	0.0	3.1	3.6	0.0
<b>Total</b>	<b>531.8</b>	<b>296.3</b>	<b>189.5</b>	<b>195.0</b>	<b>84.8</b>	<b>314.9</b>	<b>22.0</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	4.5 %	1.8 %	3.7 %	3.2 %
15-35	4.5 %	5.1 %	4.2 %	4.7 %
36-60	-	4.4 %	4.3 %	4.3 %
61-90	-	4.4 %	4.3 %	4.4 %
91-180	-	4.6 %	4.1 %	4.2 %
>180	-	4.6 %	3.8 %	4.2 %
<b>Total</b>	<b>4.5 %</b>	<b>3.7 %</b>	<b>4.1 %</b>	<b>4.0 %</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	20 al 24 de abril				27 de abr. al 1 de mayo				4 al 8 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	127	3942	3466	6	91	1335	2366	7	71	2115	1913
Intragrupa y off-shore***	0	0	2072	1808	0	0	1459	352	0	0	1285	979
Otros	127	14	697	1437	91	6	473	548	71	7	382	890
<b>Total</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>6711</b>	<b>6711</b>	<b>98</b>	<b>98</b>	<b>3267</b>	<b>3267</b>	<b>78</b>	<b>78</b>	<b>3782</b>	<b>3782</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.