

Fecha de Publicación: 23 de abril de 2015

Fecha de Información: 21 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\$1942.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.<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	527.7	298.2	140.7	361.4	37.5	46.3	120.0
15-35	386.7	467.0	384.4	167.5	17.5	154.2	65.0
36-60	205.8	38.2	5.1	0.0	33.1	205.8	0.0
61-90	0.3	19.8	0.0	0.0	19.8	0.3	0.0
91-180	60.2	110.2	0.1	0.0	110.1	60.2	0.0
>180	3.4	9.5	5.0	2.5	4.5	0.9	0.0
<b>Total</b>	<b>1184.1</b>	<b>942.8</b>	<b>535.2</b>	<b>531.4</b>	<b>222.6</b>	<b>467.7</b>	<b>185.0</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	3.4 %	3.6 %	3.2 %	3.4 %
15-35	4.3 %	4.8 %	3.7 %	4.3 %
36-60	-	4.6 %	4.1 %	4.2 %
61-90	-	4.5 %	3.9 %	4.5 %
91-180	-	4.5 %	3.8 %	4.3 %
>180	-	4.1 %	3.8 %	4.1 %
<b>Total</b>	<b>3.7 %</b>	<b>4.4 %</b>	<b>3.7 %</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

Sector	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	120	4321	3711	6	91	1461	2415	7	71	2155	1918
Intragruppo y off-shore***	0	0	2184	2060	0	0	1488	446	0	0	1285	995
Otros	120	14	710	1444	90	6	493	581	71	7	387	914
<b>Total</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>7214</b>	<b>7214</b>	<b>97</b>	<b>97</b>	<b>3442</b>	<b>3442</b>	<b>77</b>	<b>77</b>	<b>3827</b>	<b>3827</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.