

Fecha de Publicación: 4 de mayo de 2015

Fecha de Información: 29 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\$1544.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.<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	387.0	253.3	54.0	188.0	73.3	73.0	126.0
15-35	426.0	347.2	190.0	158.3	58.2	168.7	99.0
36-60	117.1	23.5	0.0	0.0	23.5	117.1	0.0
61-90	71.4	41.4	0.2	0.0	26.2	56.4	15.0
91-180	12.8	64.5	10.0	0.0	44.5	2.8	10.0
>180	6.3	50.6	0.1	0.0	44.5	0.3	6.0
<b>Total</b>	<b>1020.4</b>	<b>780.5</b>	<b>254.3</b>	<b>346.3</b>	<b>270.2</b>	<b>418.2</b>	<b>256.0</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	3.1 %	3.9 %	3.1 %	3.3 %
15-35	3.3 %	3.7 %	3.1 %	3.4 %
36-60	-	4.0 %	3.2 %	3.3 %
61-90	3.5 %	3.8 %	3.3 %	3.5 %
91-180	3.9 %	4.1 %	3.7 %	4.0 %
>180	3.9 %	4.1 %	3.3 %	4.1 %
<b>Total</b>	<b>3.3 %</b>	<b>3.8 %</b>	<b>3.1 %</b>	<b>3.4 %</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	27 de abr. al 1 de mayo				4 al 8 de mayo				11 al 15 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	76	2521	2687	20	97	2841	2628	21	97	2797	3195
Intragrupa y off-shore***	0	0	1608	1326	0	0	1629	1396	0	0	2134	918
Otros	76	9	547	663	97	20	545	991	97	21	565	1383
<b>Total</b>	<b>84</b>	<b>84</b>	<b>4676</b>	<b>4676</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>5016</b>	<b>5016</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>5496</b>	<b>5496</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.