

Fecha de Publicación: 7 de mayo de 2015

Fecha de Información: 05 de mayo 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\$1759.9 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	394.9	255.7	29.8	255.8	112.9	26.1	113.0
15-35	328.0	448.7	313.0	191.2	14.2	15.3	121.5
36-60	213.6	74.6	0.1	25.0	73.5	187.6	1.0
61-90	1.1	13.5	3.0	0.0	10.6	1.1	0.0
91-180	125.2	105.4	21.9	0.0	33.5	75.2	50.0
>180	45.5	59.2	24.6	0.0	14.6	25.5	20.0
<b>Total</b>	<b>1108.2</b>	<b>957.1</b>	<b>392.3</b>	<b>472.0</b>	<b>259.3</b>	<b>330.8</b>	<b>305.5</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	4.9 %	3.2 %	4.0 %	4.0 %
15-35	3.0 %	3.3 %	2.8 %	3.1 %
36-60	3.1 %	3.5 %	2.9 %	3.0 %
61-90	-	3.8 %	3.1 %	3.7 %
91-180	3.3 %	3.9 %	3.0 %	3.3 %
>180	3.8 %	4.0 %	3.5 %	3.8 %
<b>Total</b>	<b>3.8 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.3 %</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	4 al 8 de mayo				11 al 15 de mayo				18 al 22 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	93	3422	2946	27	102	2973	3410	30	122	2318	2220
Intragrupa y off-shore***	0	0	1757	1757	0	0	2183	962	25	0	1182	636
Otros	93	26	568	1044	102	27	660	1444	97	30	333	977
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>5747</b>	<b>5747</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>5817</b>	<b>5817</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>3833</b>	<b>3833</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.