

Fecha de Publicación: 11 de mayo de 2015

Fecha de Información: 07 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\$1607.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.<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	404.8	250.3	32.0	180.5	53.8	59.8	164.5
15-35	442.5	452.7	332.6	178.5	13.1	157.0	107.0
36-60	29.5	48.8	10.0	0.0	33.8	24.5	5.0
61-90	26.2	12.0	0.0	20.0	7.0	1.2	5.0
91-180	70.5	103.3	20.0	0.0	68.3	55.5	15.0
>180	15.0	63.0	40.0	0.0	8.0	0.0	15.0
<b>Total</b>	<b>988.5</b>	<b>930.0</b>	<b>434.6</b>	<b>379.0</b>	<b>183.9</b>	<b>298.0</b>	<b>311.5</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	2.9 %	2.8 %	1.6 %	2.2 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
36-60	2.9 %	3.0 %	2.2 %	2.7 %
61-90	3.4 %	3.6 %	3.2 %	3.3 %
91-180	3.3 %	3.5 %	2.5 %	3.1 %
>180	3.7 %	3.9 %	-	3.8 %
<b>Total</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.4 %</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**	27	94	3742	2980	29	104	3379	3646	30	125	2542	2368
Intragrupa y off-shore***	0	0	1778	2051	0	0	2203	1203	25	0	1237	676
Otros	93	27	561	1050	104	29	731	1465	101	30	381	1116
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>6082</b>	<b>6082</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>6314</b>	<b>6314</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>4160</b>	<b>4160</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.