

Fecha de Publicación: 12 de mayo de 2015

Fecha de Información: 08 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\$1524.6 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	485.9	137.7	25.5	346.0	12.2	39.9	100.0
15-35	371.5	415.9	277.3	116.5	46.6	163.0	92.0
36-60	44.9	111.3	50.0	0.6	21.3	4.3	40.0
61-90	32.5	19.7	0.0	1.0	19.7	31.5	0.0
91-180	25.1	85.1	38.0	0.0	22.1	0.1	25.0
>180	20.0	51.9	20.9	0.0	11.0	0.0	20.0
<b>Total</b>	<b>979.9</b>	<b>821.7</b>	<b>411.7</b>	<b>464.1</b>	<b>133.0</b>	<b>238.8</b>	<b>277.0</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	2.3 %	2.7 %	1.7 %	1.9 %
15-35	2.4 %	2.4 %	2.3 %	2.4 %
36-60	2.1 %	2.3 %	0.7 %	2.2 %
61-90	-	3.5 %	2.7 %	3.0 %
91-180	3.2 %	3.8 %	2.4 %	3.6 %
>180	3.8 %	3.9 %	-	3.8 %
<b>Total</b>	<b>2.5 %</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	88	3742	2983	35	134	3733	3690	30	127	2666	2424
Intragrupa y off-shore***	0	0	1778	2051	0	0	2205	1471	25	0	1261	754
Otros	88	27	564	1050	134	35	698	1475	102	30	389	1137
<b>Total</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>6084</b>	<b>6084</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>6636</b>	<b>6636</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>4316</b>	<b>4316</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.