

Fecha de Publicación: 15 de mayo de 2015

Fecha de Información: 13 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\$2102.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.<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	737.1	345.9	212.5	560.5	35.4	78.6	98.0
15-35	331.4	600.5	456.5	42.5	59.0	203.9	85.0
36-60	26.4	48.4	30.0	0.0	18.4	26.4	0.0
61-90	57.9	5.6	0.0	20.0	5.6	37.9	0.0
91-180	93.8	24.7	0.0	0.0	24.7	93.8	0.0
>180	12.5	11.2	0.0	0.0	1.2	2.5	10.0
<b>Total</b>	<b>1259.1</b>	<b>1036.4</b>	<b>699.0</b>	<b>623.0</b>	<b>144.4</b>	<b>443.1</b>	<b>193.0</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	2.8 %	2.7 %	0.2 %	1.1 %
15-35	2.5 %	2.2 %	2.3 %	2.3 %
36-60	-	3.0 %	2.5 %	2.8 %
61-90	-	3.8 %	3.1 %	3.1 %
91-180	-	4.0 %	3.0 %	3.2 %
>180	3.7 %	4.8 %	3.5 %	3.8 %
<b>Total</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.5 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.8 %</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	11 al 15 de mayo				18 al 22 de mayo				25 al 29 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	129	4703	3934	72	128	3108	2850	33	82	2147	2297
Intragruppo y off-shore***	0	0	2288	2268	25	0	1450	941	0	18	1142	489
Otros	129	37	712	1501	103	72	473	1240	82	15	649	1153
<b>Total</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>7703</b>	<b>7703</b>	<b>200</b>	<b>200</b>	<b>5031</b>	<b>5031</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>3939</b>	<b>3939</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.