

Fecha de Publicación: 21 de mayo de 2015

Fecha de Información: 19 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\$1903.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.<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	388.3	315.9	204.0	206.0	6.9	77.3	105.0
15-35	436.6	727.2	564.6	58.0	20.8	236.8	141.8
36-60	29.2	24.2	15.0	0.0	9.2	29.2	0.0
61-90	11.6	26.7	0.0	0.0	26.7	11.6	0.0
91-180	60.0	80.1	0.0	0.4	79.9	59.4	0.2
>180	35.1	35.3	0.0	0.0	15.2	15.0	20.1
<b>Total</b>	<b>960.8</b>	<b>1209.4</b>	<b>783.6</b>	<b>264.4</b>	<b>158.8</b>	<b>429.3</b>	<b>267.0</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	3.9 %	3.2 %	2.0 %	2.8 %
15-35	4.0 %	2.9 %	3.7 %	3.3 %
36-60	-	4.2 %	2.8 %	3.1 %
61-90	-	3.8 %	2.9 %	3.5 %
91-180	3.8 %	4.0 %	3.5 %	3.8 %
>180	4.0 %	4.3 %	3.5 %	3.9 %
<b>Total</b>	<b>3.9 %</b>	<b>3.2 %</b>	<b>2.9 %</b>	<b>3.2 %</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	18 al 22 de mayo				25 al 29 de mayo				1 al 5 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	79	128	3398	3061	35	84	2452	2607	9	77	2819	2740
Intragrupa y off-shore***	25	0	1576	1147	0	18	1303	594	0	0	1813	817
Otros	103	79	519	1285	84	17	698	1253	76	9	377	1451
<b>Total</b>	<b>207</b>	<b>207</b>	<b>5494</b>	<b>5494</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>4454</b>	<b>4454</b>	<b>86</b>	<b>86</b>	<b>5008</b>	<b>5008</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.