

Fecha de Publicación: 22 de mayo de 2015

Fecha de Información: 20 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\$1801.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.<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	422.1	198.4	154.0	364.8	19.9	32.8	24.5
15-35	533.6	536.2	433.4	225.3	19.6	225.2	83.2
36-60	46.2	11.0	0.0	0.0	11.0	46.2	0.0
61-90	15.1	13.6	0.0	0.0	13.6	15.1	0.0
91-180	90.4	24.2	0.0	5.0	4.2	65.4	20.0
>180	19.8	28.6	15.0	5.0	3.6	4.8	10.0
<b>Total</b>	<b>1127.3</b>	<b>812.1</b>	<b>602.4</b>	<b>600.0</b>	<b>72.0</b>	<b>389.6</b>	<b>137.7</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	4.1 %	1.8 %	3.1 %	2.8 %
15-35	3.0 %	4.1 %	3.8 %	3.9 %
36-60	-	4.4 %	3.2 %	3.5 %
61-90	-	4.4 %	3.1 %	3.7 %
91-180	3.8 %	4.4 %	3.5 %	3.6 %
>180	3.7 %	3.9 %	3.6 %	3.8 %
<b>Total</b>	<b>3.3 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.5 %</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	123	3605	3093	37	84	2619	2655	9	76	2873	2921
Intragrupa y off-shore***	25	0	1607	1346	0	18	1333	746	0	0	1969	831
Otros	98	79	520	1294	84	19	710	1261	76	9	383	1473
<b>Total</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>5733</b>	<b>5733</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>4662</b>	<b>4662</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>5225</b>	<b>5225</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.