

Fecha de Publicación: 26 de mayo de 2015

Fecha de Información: 22 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\$966.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.<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	134.3	109.2	44.0	31.0	38.2	76.3	27.0
15-35	441.1	370.3	222.5	31.5	18.3	280.1	129.5
36-60	5.3	6.4	0.0	0.0	6.4	5.3	0.0
61-90	20.6	6.2	0.0	0.0	6.2	20.6	0.0
91-180	7.5	17.4	0.0	0.0	17.4	7.5	0.0
>180	1.1	3.6	0.0	0.0	3.6	1.1	0.0
<b>Total</b>	<b>609.8</b>	<b>513.1</b>	<b>266.5</b>	<b>62.5</b>	<b>90.1</b>	<b>390.8</b>	<b>156.5</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	3.7 %	4.1 %	2.3 %	3.0 %
15-35	3.7 %	3.7 %	3.4 %	3.5 %
36-60	-	4.3 %	1.7 %	3.1 %
61-90	-	4.2 %	2.7 %	3.1 %
91-180	-	4.1 %	-3.4 %	1.8 %
>180	-	4.2 %	3.4 %	4.0 %
<b>Total</b>	<b>3.7 %</b>	<b>3.8 %</b>	<b>3.0 %</b>	<b>3.4 %</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	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**	80	117	3784	3186	37	88	2763	2745	9	76	2949	2975
Intragrupa y off-shore***	25	0	1619	1478	0	18	1373	822	0	0	1983	842
Otros	92	80	559	1298	88	19	745	1314	76	9	402	1516
<b>Total</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>5962</b>	<b>5962</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>4881</b>	<b>4881</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>5333</b>	<b>5333</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.