

Fecha de Publicación: 28 de mayo de 2015

Fecha de Información: 26 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\$2135.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.<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	454.7	434.0	242.5	260.5	32.5	35.2	159.0
15-35	537.2	567.1	458.0	179.8	31.1	279.5	78.0
36-60	86.1	36.3	15.5	0.0	5.7	71.1	15.0
61-90	18.0	35.6	0.0	0.0	35.6	18.0	0.0
91-180	34.0	85.0	0.0	0.0	75.0	24.0	10.0
>180	94.8	87.6	0.0	10.0	14.6	11.8	73.0
<b>Total</b>	<b>1224.8</b>	<b>1245.6</b>	<b>716.0</b>	<b>450.3</b>	<b>194.6</b>	<b>439.5</b>	<b>335.0</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	-4.9 %	4.1 %	4.2 %	1.2 %
15-35	3.9 %	3.5 %	4.1 %	3.8 %
36-60	1.2 %	4.2 %	3.7 %	3.5 %
61-90	-	4.0 %	3.1 %	3.7 %
91-180	3.7 %	3.9 %	3.0 %	3.7 %
>180	3.8 %	4.0 %	2.7 %	3.7 %
<b>Total</b>	<b>-0.4 %</b>	<b>3.8 %</b>	<b>4.0 %</b>	<b>3.1 %</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	25 al 29 de mayo				1 al 5 de junio				8 al 12 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	92	3127	2956	10	76	3002	3147	18	127	3056	3929
Intragruppo y off-shore***	0	18	1420	1046	0	0	2127	869	0	0	2486	640
Otros	92	19	786	1330	76	10	409	1522	127	18	654	1627
<b>Total</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>5333</b>	<b>5333</b>	<b>86</b>	<b>86</b>	<b>5537</b>	<b>5537</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>6196</b>	<b>6196</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.