

Fecha de Publicación: 2 de junio de 2015

Fecha de Información: 29 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\$1527.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.<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	337.7	288.7	121.5	140.9	15.2	44.8	152.0
15-35	363.8	542.7	320.0	104.3	109.7	146.5	113.0
36-60	127.8	13.0	0.0	0.0	13.0	127.8	0.0
61-90	17.0	16.7	5.5	0.0	11.2	17.0	0.0
91-180	20.6	14.4	0.0	0.0	9.4	15.6	5.0
>180	11.3	43.9	0.0	10.0	43.9	1.3	0.0
<b>Total</b>	<b>878.2</b>	<b>919.4</b>	<b>447.0</b>	<b>255.2</b>	<b>202.4</b>	<b>353.0</b>	<b>270.0</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	3.9 %	4.0 %	3.7 %	3.8 %
15-35	3.8 %	3.8 %	3.6 %	3.7 %
36-60	-	3.9 %	3.3 %	3.4 %
61-90	-	3.9 %	3.0 %	3.4 %
91-180	3.6 %	4.2 %	3.6 %	3.8 %
>180	-	3.9 %	3.3 %	3.8 %
<b>Total</b>	<b>3.8 %</b>	<b>3.8 %</b>	<b>3.5 %</b>	<b>3.7 %</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**	35	86	3210	3010	11	82	3445	3669	24	128	3190	4100
Intragruppo y off-shore***	0	18	1441	1093	0	0	2411	1039	0	0	2559	665
Otros	86	17	806	1354	82	11	432	1581	128	24	696	1679
<b>Total</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>5457</b>	<b>5457</b>	<b>93</b>	<b>93</b>	<b>6288</b>	<b>6288</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>6445</b>	<b>6445</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.