

Fecha de Publicación: 9 de junio de 2015

Fecha de Información: 04 de junio 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\$1455.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.<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	185.9	157.2	77.5	106.5	18.7	18.4	61.0
15-35	425.1	521.3	376.0	100.8	26.8	205.8	118.5
36-60	59.1	19.3	0.0	0.0	19.3	59.1	0.0
61-90	22.7	35.7	30.0	10.0	5.7	12.7	0.0
91-180	80.6	119.6	50.0	10.0	59.6	60.6	10.0
>180	18.4	10.3	0.0	0.0	0.3	8.4	10.0
<b>Total</b>	<b>791.9</b>	<b>863.4</b>	<b>533.5</b>	<b>227.3</b>	<b>130.4</b>	<b>365.1</b>	<b>199.5</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	3.8 %	4.3 %	2.0 %	3.2 %
15-35	4.1 %	3.7 %	3.7 %	3.8 %
36-60	-	4.2 %	3.9 %	4.0 %
61-90	-	2.9 %	4.1 %	3.3 %
91-180	3.7 %	4.2 %	3.9 %	4.0 %
>180	4.0 %	4.5 %	3.6 %	3.8 %
<b>Total</b>	<b>4.0 %</b>	<b>3.8 %</b>	<b>3.4 %</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

Sector	1 al 5 de junio				8 al 12 de junio				15 al 19 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	81	4237	3903	159	123	3544	4502	37	96	2640	2996
Intragrupa y off-shore***	0	0	2599	1781	0	0	2810	823	0	0	1931	685
Otros	81	14	449	1601	123	159	726	1756	96	37	512	1403
<b>Total</b>	<b>96</b>	<b>96</b>	<b>7285</b>	<b>7285</b>	<b>281</b>	<b>281</b>	<b>7080</b>	<b>7080</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>5084</b>	<b>5084</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.