

Fecha de Publicación: 12 de junio de 2015

Fecha de Información: 10 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\$2855.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.8%.<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	982.6	375.1	247.9	864.8	40.2	30.7	87.0
15-35	635.7	586.4	435.5	288.8	41.9	237.9	109.0
36-60	0.3	32.5	23.7	0.0	8.8	0.3	0.0
61-90	9.7	61.1	0.0	0.0	52.7	1.3	8.4
91-180	26.0	338.8	195.0	0.0	118.8	1.0	25.0
>180	26.9	17.0	0.0	10.0	10.0	9.9	7.0
<b>Total</b>	<b>1681.2</b>	<b>1410.9</b>	<b>902.2</b>	<b>1163.6</b>	<b>272.4</b>	<b>281.2</b>	<b>236.4</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	1.7 %	2.8 %	1.6 %	1.9 %
15-35	3.5 %	3.6 %	2.9 %	3.2 %
36-60	-	5.8 %	3.4 %	5.7 %
61-90	3.4 %	4.7 %	3.5 %	4.5 %
91-180	3.3 %	3.9 %	3.7 %	3.8 %
>180	4.0 %	3.5 %	3.5 %	3.6 %
<b>Total</b>	<b>2.8 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.8 %</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	8 al 12 de junio				15 al 19 de junio				22 al 26 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	168	132	4947	4833	94	98	2915	3368	19	93	2760	3230
Intragruppo y off-shore***	0	0	2991	2079	0	0	2133	862	0	0	1833	669
Otros	132	168	775	1801	98	94	623	1441	93	19	699	1394
<b>Total</b>	<b>300</b>	<b>300</b>	<b>8713</b>	<b>8713</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>5671</b>	<b>5671</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>5292</b>	<b>5292</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.