

Fecha de Publicación: 16 de junio de 2015

Fecha de Información: 11 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\$1872.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.<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	338.9	131.3	66.3	258.5	7.0	22.4	58.0
15-35	293.1	694.2	626.0	61.0	42.2	206.1	26.0
36-60	161.5	34.0	0.0	0.0	34.0	161.5	0.0
61-90	32.6	22.8	10.0	0.0	7.8	27.6	5.0
91-180	65.5	162.3	40.0	0.0	82.3	25.5	40.0
>180	56.0	9.4	0.0	50.0	9.4	6.0	0.0
<b>Total</b>	<b>947.6</b>	<b>1054.1</b>	<b>742.3</b>	<b>369.5</b>	<b>182.8</b>	<b>449.1</b>	<b>129.0</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 %	3.7 %	2.2 %	2.7 %
15-35	4.0 %	3.8 %	3.5 %	3.7 %
36-60	-	4.1 %	3.3 %	3.5 %
61-90	3.8 %	3.6 %	3.6 %	3.6 %
91-180	4.0 %	4.1 %	3.5 %	4.0 %
>180	-	4.1 %	3.7 %	3.8 %
<b>Total</b>	<b>3.9 %</b>	<b>3.8 %</b>	<b>3.0 %</b>	<b>3.5 %</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	130	5134	4844	108	97	3025	3427	21	92	2797	3294
Intragruppo y off-shore***	0	0	2991	2253	0	0	2170	946	0	0	1862	669
Otros	130	168	776	1804	97	108	626	1449	92	21	705	1401
<b>Total</b>	<b>298</b>	<b>298</b>	<b>8901</b>	<b>8901</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>5822</b>	<b>5822</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>5364</b>	<b>5364</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.