

Fecha de Publicación: 18 de junio de 2015

Fecha de Información: 16 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\$1431.4 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	355.8	212.0	27.0	138.0	18.0	50.8	167.0
15-35	458.9	421.1	276.0	61.0	19.1	271.9	126.0
36-60	35.2	27.1	0.0	0.0	12.1	20.2	15.0
61-90	7.0	41.1	3.4	0.0	37.7	7.0	0.0
91-180	66.2	78.6	0.0	0.0	78.6	66.2	0.0
>180	30.4	6.1	0.3	10.0	5.9	20.4	0.0
<b>Total</b>	<b>953.4</b>	<b>786.0</b>	<b>306.7</b>	<b>209.0</b>	<b>171.3</b>	<b>436.4</b>	<b>308.0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.0 %	2.7 %	2.3 %	3.1 %
15-35	4.1 %	4.2 %	3.8 %	4.0 %
36-60	4.0 %	4.4 %	3.8 %	4.0 %
61-90	-	4.5 %	3.7 %	4.3 %
91-180	-	4.3 %	3.6 %	4.0 %
>180	-	4.3 %	3.6 %	3.7 %
<b>Total</b>	<b>4.0 %</b>	<b>4.1 %</b>	<b>3.3 %</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	15 al 19 de junio				22 al 26 de junio				29 de jun. al 3 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	108	104	3452	3685	21	97	3040	3453	5	52	2201	3048
Intragrupa y off-shore***	0	0	2231	1127	0	0	1870	693	0	0	1941	668
Otros	104	108	623	1494	97	21	719	1482	52	5	381	807
<b>Total</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>6306</b>	<b>6306</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>5628</b>	<b>5628</b>	<b>57</b>	<b>57</b>	<b>4523</b>	<b>4523</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.