

Fecha de Publicación: 23 de junio de 2015

Fecha de Información: 19 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\$746.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.<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	177.1	95.0	68.0	111.0	7.0	46.1	20.0
15-35	261.7	201.3	161.0	65.3	19.3	175.4	21.0
36-60	2.5	6.1	0.0	0.0	6.1	2.5	0.0
61-90	2.9	4.5	0.0	0.0	4.5	2.9	0.0
91-180	11.6	19.6	0.0	0.0	19.6	11.6	0.0
>180	4.2	0.5	0.0	0.0	0.5	4.2	0.0
<b>Total</b>	<b>459.9</b>	<b>327.1</b>	<b>229.0</b>	<b>176.3</b>	<b>57.1</b>	<b>242.7</b>	<b>41.0</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	4.3 %	4.1 %	3.4 %	3.7 %
15-35	4.2 %	4.2 %	3.8 %	4.0 %
36-60	-	4.5 %	2.6 %	3.9 %
61-90	-	4.0 %	3.1 %	3.7 %
91-180	-	4.2 %	3.5 %	3.9 %
>180	-	4.5 %	2.7 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>4.2 %</b>	<b>4.2 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.9 %</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	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**	94	98	4013	3773	34	97	3263	3858	5	55	2447	3174
Intragrupa y off-shore***	0	0	2282	1644	0	0	2194	836	0	0	1992	764
Otros	98	94	620	1499	97	34	742	1505	55	5	405	907
<b>Total</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>6916</b>	<b>6916</b>	<b>131</b>	<b>131</b>	<b>6200</b>	<b>6200</b>	<b>60</b>	<b>60</b>	<b>4844</b>	<b>4844</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 intragrupo.