

Fecha de Publicación: 24 de junio de 2015

Fecha de Información: 22 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\$1313.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.<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	270.1	298.5	116.0	74.5	22.5	35.6	160.0
15-35	491.2	390.0	224.5	113.5	19.5	231.7	146.0
36-60	56.2	34.8	0.0	0.0	4.8	26.2	30.0
61-90	0.1	8.5	0.0	0.0	8.5	0.1	0.0
91-180	5.4	92.2	0.0	0.0	92.2	5.4	0.0
>180	0.0	2.3	0.0	0.0	2.3	0.0	0.0
<b>Total</b>	<b>822.9</b>	<b>826.2</b>	<b>340.5</b>	<b>188.0</b>	<b>149.7</b>	<b>298.9</b>	<b>336.0</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	3.9 %	3.8 %	2.9 %	3.6 %
15-35	3.9 %	4.1 %	3.8 %	3.9 %
36-60	2.0 %	4.4 %	3.9 %	3.0 %
61-90	-	5.4 %	3.3 %	5.4 %
91-180	-	4.2 %	3.7 %	4.1 %
>180	-	4.4 %	-	4.4 %
<b>Total</b>	<b>3.7 %</b>	<b>4.1 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.8 %</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	22 al 26 de junio				29 de jun. al 3 de julio				6 al 10 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	101	3424	4034	5	55	2491	3212	12	95	2419	2593
Intragrupa y off-shore***	0	0	2280	888	0	0	1992	775	0	0	1527	924
Otros	101	35	742	1525	55	5	413	910	95	12	635	1064
<b>Total</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>6447</b>	<b>6447</b>	<b>61</b>	<b>61</b>	<b>4896</b>	<b>4896</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>4581</b>	<b>4581</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.