

Fecha de Publicación: 9 de enero de 2015

Fecha de Información: 07 de enero 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\$1322,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	369,2	249,5	76,1	183,1	41,4	54,1	132,0
15-35	269,9	466,7	339,6	72,5	51,1	121,4	76,0
36-60	2,3	48,3	36,1	0,0	12,2	2,3	0,0
61-90	21,0	10,6	0,0	20,0	10,6	1,0	0,0
91-180	6,9	10,6	0,0	0,0	10,6	6,9	0,0
>180	10,3	65,2	56,0	10,0	9,2	0,3	0,0
<b>Total</b>	<b>679,5</b>	<b>850,9</b>	<b>507,8</b>	<b>285,6</b>	<b>135,1</b>	<b>185,9</b>	<b>208,0</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	1,8 %	3,3 %	2,9 %	2,7 %
15-35	1,6 %	3,6 %	3,0 %	3,2 %
36-60	-	3,4 %	2,1 %	3,3 %
61-90	-	1,7 %	3,5 %	2,9 %
91-180	-	4,0 %	2,3 %	3,4 %
>180	-	3,4 %	3,3 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>1,7 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,0 %</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	5 al 9 de enero				12 al 16 de enero				19 al 23 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	28	86	2630	3088	63	129	2782	2895	11	67	1893	2472
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1960	1165	0	0	1657	619	0	0	1128	398
<b>Otros</b>	86	28	430	767	129	63	632	1558	67	11	741	893
<b>Total</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>5020</b>	<b>5020</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>5072</b>	<b>5072</b>	<b>78</b>	<b>78</b>	<b>3763</b>	<b>3763</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.