

Fecha de Publicación: 19 de enero de 2015

Fecha de Información: 15 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\$1764,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	199,7	65,2	48,2	161,0	15,1	36,7	2,0
15-35	466,5	629,1	474,5	217,0	55,6	150,5	99,0
36-60	90,9	20,1	1,9	0,0	18,2	90,9	0,0
61-90	133,8	79,2	68,9	0,0	10,3	133,8	0,0
91-180	89,4	71,0	40,0	0,0	31,0	89,4	0,0
>180	11,3	9,4	0,0	10,0	9,4	1,3	0,0
<b>Total</b>	<b>991,5</b>	<b>874,0</b>	<b>633,5</b>	<b>388,0</b>	<b>139,5</b>	<b>502,5</b>	<b>101,0</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	3,3 %	3,9 %	1,9 %	2,4 %
15-35	3,8 %	3,8 %	3,2 %	3,6 %
36-60	-	4,3 %	2,9 %	3,1 %
61-90	-	3,9 %	3,5 %	3,6 %
91-180	-	3,8 %	3,3 %	3,5 %
>180	-	4,8 %	3,4 %	4,6 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,4 %</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	12 al 16 de enero				19 al 23 de enero				26 al 30 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	65	135	3762	3396	23	83	2135	2646	14	91	1105	1619
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1881	1321	0	0	1234	465	0	0	945	198
<b>Otros</b>	135	65	695	1621	83	23	790	1048	91	14	531	764
<b>Total</b>	<b>200</b>	<b>200</b>	<b>6338</b>	<b>6338</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>4159</b>	<b>4159</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>2580</b>	<b>2580</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.