

Fecha de Publicación: 22 de enero de 2015

Fecha de Información: 20 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\$1201,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	196,3	105,9	62,4	155,4	23,5	20,9	20,0
15-35	230,1	294,9	256,0	124,9	8,9	75,2	30,0
36-60	104,9	41,1	30,0	0,0	11,1	104,9	0,0
61-90	45,1	20,9	10,0	0,0	10,9	45,1	0,0
91-180	120,1	72,6	20,0	42,0	52,6	78,1	0,0
>180	7,1	12,6	10,0	0,0	2,6	7,1	0,0
<b>Total</b>	<b>703,6</b>	<b>548,1</b>	<b>388,4</b>	<b>322,3</b>	<b>109,7</b>	<b>331,3</b>	<b>50,0</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	0,9 %	3,7 %	1,8 %	2,2 %
15-35	3,7 %	3,7 %	3,5 %	3,7 %
36-60	-	4,1 %	3,4 %	3,6 %
61-90	-	3,8 %	3,5 %	3,6 %
91-180	-	3,8 %	3,4 %	3,6 %
>180	-	3,6 %	3,5 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,3 %</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	19 al 23 de enero				26 al 30 de enero				2 al 6 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	85	2574	2876	18	95	1160	1743	4	70	1872	2391
Intragrupa y off-shore***	0	0	1314	753	0	0	1016	223	0	0	1290	433
Otros	85	27	813	1072	95	18	569	778	70	4	433	769
<b>Total</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>4701</b>	<b>4701</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>2744</b>	<b>2744</b>	<b>74</b>	<b>74</b>	<b>3594</b>	<b>3594</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.