

Fecha de Publicación: 26 de enero de 2015

Fecha de Información: 22 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\$895,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	155,1	248,9	153,0	60,3	16,9	15,9	79,0
15-35	173,9	304,0	291,8	25,5	12,3	148,4	0,0
36-60	11,5	5,7	0,0	0,0	5,7	11,5	0,0
61-90	5,2	7,4	0,0	0,0	7,4	5,2	0,0
91-180	23,7	6,0	0,0	0,0	6,0	23,7	0,0
>180	32,5	0,2	0,0	0,0	0,2	32,5	0,0
<b>Total</b>	<b>401,8</b>	<b>572,3</b>	<b>444,8</b>	<b>85,8</b>	<b>48,5</b>	<b>237,1</b>	<b>79,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,2 %	3,5 %	1,9 %	2,5 %
15-35	-	3,5 %	2,9 %	3,3 %
36-60	-	4,0 %	3,2 %	3,4 %
61-90	-	4,6 %	3,0 %	4,0 %
91-180	-	4,0 %	2,9 %	3,1 %
>180	-	3,6 %	3,2 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>1,2 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>2,7 %</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	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**	31	88	2968	2900	22	104	1352	1988	4	74	2071	2603
Intragruppo y off-shore***	0	0	1321	1128	0	0	1182	345	0	0	1395	492
Otros	88	31	823	1084	104	22	605	806	74	4	468	839
<b>Total</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>5112</b>	<b>5112</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>3139</b>	<b>3139</b>	<b>79</b>	<b>79</b>	<b>3934</b>	<b>3934</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 intragruppo.