

Fecha de Publicación: 27 de enero de 2015

Fecha de Información: 23 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\$992,4 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         | 256,8               | 231,8        | 155,5                     | 115,8        | 4,3           | 69,0         | 72,0           |
| 15-35        | 133,7               | 378,2        | 311,4                     | 41,1         | 11,8          | 37,6         | 55,0           |
| 36-60        | 4,3                 | 11,1         | 0,0                       | 0,0          | 11,1          | 4,3          | 0,0            |
| 61-90        | 1,9                 | 27,5         | 25,0                      | 0,0          | 2,5           | 1,9          | 0,0            |
| 91-180       | 27,8                | 38,7         | 10,0                      | 0,0          | 3,7           | 2,8          | 25,0           |
| >180         | 32,0                | 10,6         | 0,0                       | 10,0         | 0,6           | 12,0         | 10,0           |
| <b>Total</b> | <b>456,5</b>        | <b>698,0</b> | <b>501,9</b>              | <b>166,9</b> | <b>34,0</b>   | <b>127,6</b> | <b>162,0</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         | 1,2 %              | 3,4 %                        | 3,0 %        | 2,8 %        |
| 15-35        | 3,1 %              | 3,8 %                        | 3,5 %        | 3,7 %        |
| 36-60        | -                  | 4,1 %                        | 2,6 %        | 3,7 %        |
| 61-90        | -                  | 3,7 %                        | 3,0 %        | 3,7 %        |
| 91-180       | 3,5 %              | 3,6 %                        | 2,9 %        | 3,5 %        |
| >180         | 3,4 %              | 4,0 %                        | 3,3 %        | 3,3 %        |
| <b>Total</b> | <b>2,4 %</b>       | <b>3,7 %</b>                 | <b>3,1 %</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**       | 31                | 87         | 2968        | 2905        | 23                | 110        | 1558        | 2165        | 5                 | 73        | 2121        | 2653        |
| Intragrupa y off-shore*** | 0                 | 0          | 1321        | 1128        | 0                 | 0          | 1302        | 460         | 0                 | 0         | 1430        | 493         |
| Otros                     | 86                | 31         | 828         | 1084        | 110               | 23         | 602         | 837         | 73                | 5         | 470         | 877         |
| <b>Total</b>              | <b>118</b>        | <b>118</b> | <b>5118</b> | <b>5118</b> | <b>132</b>        | <b>132</b> | <b>3462</b> | <b>3462</b> | <b>78</b>         | <b>78</b> | <b>4022</b> | <b>4022</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.