

Fecha de Publicación: 29 de enero de 2015

Fecha de Información: 27 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\$1958,2 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	306,5	132,6	43,0	221,0	16,6	12,5	73,0
15-35	785,3	699,0	424,0	210,6	13,0	312,7	262,0
36-60	151,6	42,2	1,2	0,0	41,0	151,6	0,0
61-90	2,5	19,5	10,4	0,0	9,1	2,5	0,0
91-180	25,2	44,6	20,0	20,0	24,6	5,2	0,0
>180	63,7	30,6	0,0	35,0	20,6	18,7	10,0
<b>Total</b>	<b>1334,7</b>	<b>968,5</b>	<b>498,6</b>	<b>486,6</b>	<b>124,9</b>	<b>503,1</b>	<b>345,0</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	3,0 %	3,1 %	2,8 %	2,9 %
15-35	2,6 %	3,7 %	3,6 %	3,4 %
36-60	-	4,3 %	3,5 %	3,7 %
61-90	-	4,1 %	3,0 %	3,9 %
91-180	-	2,2 %	1,0 %	1,7 %
>180	3,4 %	3,7 %	3,2 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,3 %</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	26 al 30 de enero				2 al 6 de febrero				9 al 13 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	112	1915	2282	6	73	2223	2778	12	77	2262	3256
Intragrupa y off-shore***	0	0	1331	719	0	0	1492	543	0	0	2129	740
Otros	112	22	627	872	73	6	494	889	77	12	466	862
<b>Total</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>3874</b>	<b>3874</b>	<b>80</b>	<b>80</b>	<b>4210</b>	<b>4210</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>4858</b>	<b>4858</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.