

Fecha de Publicación: 30 de enero de 2015

Fecha de Información: 28 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\$2563,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.<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	408,1	377,3	122,5	211,0	174,8	117,1	80,0
15-35	743,9	855,1	518,0	205,0	97,1	298,9	240,0
36-60	299,3	62,3	16,5	0,0	21,8	275,3	24,0
61-90	7,7	19,3	0,0	0,0	19,3	7,7	0,0
91-180	1,9	41,7	0,1	0,0	41,6	1,9	0,0
>180	80,0	11,1	0,0	80,0	11,1	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>1540,9</b>	<b>1366,8</b>	<b>657,0</b>	<b>496,0</b>	<b>365,8</b>	<b>700,9</b>	<b>344,0</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	3,5 %	3,8 %	3,2 %	3,5 %
15-35	3,3 %	4,0 %	3,3 %	3,6 %
36-60	3,4 %	4,3 %	3,2 %	3,2 %
61-90	-	5,0 %	3,0 %	4,5 %
91-180	-	3,9 %	3,2 %	3,8 %
>180	-	3,8 %	3,3 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,5 %</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**	17	110	2055	2290	20	75	2359	3006	55	78	2390	3421
Intragruppo y off-shore***	0	0	1331	848	0	0	1543	625	0	0	2201	740
Otros	110	17	635	882	75	20	651	922	78	55	500	930
<b>Total</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>4021</b>	<b>4021</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>4552</b>	<b>4552</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>5091</b>	<b>5091</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.