

Fecha de Publicación: 2 de febrero de 2015

Fecha de Información: 29 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\$1218,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.<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	217,4	224,9	40,0	117,5	105,4	20,4	79,5
15-35	251,2	529,4	383,8	28,5	24,4	101,4	121,3
36-60	95,6	20,8	0,0	0,0	20,8	95,6	0,0
61-90	6,9	12,8	0,0	0,0	12,8	6,9	0,0
91-180	24,9	6,7	0,0	0,0	6,7	24,9	0,0
>180	21,0	12,3	0,0	10,0	7,3	6,0	5,0
<b>Total</b>	<b>617,0</b>	<b>806,8</b>	<b>423,8</b>	<b>156,0</b>	<b>177,3</b>	<b>255,3</b>	<b>205,8</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	2,9 %	3,9 %	0,7 %	2,5 %
15-35	2,3 %	2,4 %	2,8 %	2,5 %
36-60	-	4,0 %	3,5 %	3,6 %
61-90	-	-8,0 %	3,0 %	-4,2 %
91-180	-	4,0 %	3,1 %	3,3 %
>180	3,3 %	3,8 %	3,0 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>2,6 %</b>	<b>2,3 %</b>	<b>2,5 %</b>

\* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	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
<b>Sector Financiero**</b>	17	105	2185	2315	21	77	2406	3084	55	78	2429	3582
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1331	965	0	0	1583	625	0	0	2241	740
<b>Otros</b>	105	17	651	887	77	21	654	933	78	55	585	933
<b>Total</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>4167</b>	<b>4167</b>	<b>98</b>	<b>98</b>	<b>4643</b>	<b>4643</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>5256</b>	<b>5256</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.