

Fecha de Publicación: 17 de diciembre de 2014

Fecha de Información: 15 de diciembre de 2014 <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\$1177,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,0%.<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	234,1	100,2	46,0	121,0	20,2	79,1	34,0
15-35	198,6	476,5	420,7	72,9	18,9	88,8	36,9
36-60	62,7	10,9	0,0	0,0	10,9	62,7	0,0
61-90	54,8	11,1	5,2	0,0	5,9	54,8	0,0
91-180	41,3	34,0	10,0	0,0	24,0	41,3	0,0
>180	22,1	6,2	0,0	0,0	2,2	18,1	4,0
<b>Total</b>	<b>613,6</b>	<b>639,0</b>	<b>481,9</b>	<b>193,9</b>	<b>82,2</b>	<b>344,8</b>	<b>74,9</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	1,3 %	2,7 %	0,7 %	1,0 %
15-35	1,6 %	2,4 %	2,1 %	2,3 %
36-60	-	3,1 %	2,0 %	2,2 %
61-90	-	3,4 %	2,5 %	2,7 %
91-180	-	2,0 %	2,6 %	2,4 %
>180	3,2 %	3,7 %	2,6 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>1,6 %</b>	<b>2,4 %</b>	<b>1,6 %</b>	<b>2,0 %</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	15 al 19 de diciembre				22 al 26 de diciembre				29 de dic. al 2 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	36	128	2932	3353	10	87	1423	1733	7	74	1265	1885
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1963	1385	0	0	1176	919	0	0	1304	837
<b>Otros</b>	128	36	591	748	87	10	273	221	74	7	248	95
<b>Total</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>5486</b>	<b>5486</b>	<b>96</b>	<b>96</b>	<b>2873</b>	<b>2873</b>	<b>81</b>	<b>81</b>	<b>2817</b>	<b>2817</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.