

Fecha de Publicación: 6 de enero de 2015

Fecha de Información: 02 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\$156,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,2	56,6	30,0	30,0	26,6	2,2	0,0
15-35	6,0	42,5	40,3	6,0	2,2	0,0	0,0
36-60	3,1	1,0	0,0	0,0	1,0	3,1	0,0
61-90	3,8	3,3	0,0	0,0	0,3	0,8	3,0
91-180	0,0	1,4	0,1	0,0	1,4	0,0	0,0
>180	2,0	7,4	0,0	0,0	7,4	2,0	0,0
<b>Total</b>	<b>47,1</b>	<b>112,3</b>	<b>70,4</b>	<b>36,0</b>	<b>38,9</b>	<b>8,1</b>	<b>3,0</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	-	2,3 %	1,2 %	1,9 %
15-35	-	2,3 %	1,9 %	2,2 %
36-60	-	3,4 %	0,6 %	1,3 %
61-90	3,3 %	3,4 %	1,4 %	3,0 %
91-180	-	-2,5 %	-	-2,5 %
>180	-	3,5 %	2,7 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</b>	<b>2,3 %</b>	<b>1,3 %</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.

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

Sector	29 de dic. al 2 de enero				5 al 9 de enero				12 al 16 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	5	80	1873	2046	26	81	1902	2857	48	126	2511	2627
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1371	1286	0	0	1841	555	0	0	1563	516
<b>Otros</b>	80	5	270	182	81	26	403	734	126	48	525	1455
<b>Total</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>3514</b>	<b>3514</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>4145</b>	<b>4145</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>4598</b>	<b>4598</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.