

Fecha de Publicación: 7 de enero de 2015

Fecha de Información: 05 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\$851,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.<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	277,7	162,4	67,3	172,0	55,1	65,7	40,0
15-35	97,7	265,3	255,0	39,0	5,3	53,7	5,0
36-60	4,5	13,7	0,0	0,0	13,7	4,5	0,0
61-90	14,5	2,1	0,0	0,0	2,1	14,5	0,0
91-180	42,2	6,1	0,0	0,0	6,1	42,2	0,0
>180	5,6	4,6	0,0	0,0	4,6	5,6	0,0
<b>Total</b>	<b>442,2</b>	<b>454,3</b>	<b>322,3</b>	<b>211,0</b>	<b>87,1</b>	<b>186,2</b>	<b>45,0</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	3,9 %	3,1 %	2,8 %	3,0 %
15-35	3,1 %	3,2 %	2,4 %	3,0 %
36-60	-	3,8 %	1,1 %	3,1 %
61-90	-	3,2 %	2,5 %	2,6 %
91-180	-	3,1 %	2,5 %	2,6 %
>180	-	3,9 %	2,1 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,6 %</b>	<b>3,0 %</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	5 al 9 de enero				12 al 16 de enero				19 al 23 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	83	2127	2917	51	126	2558	2728	10	67	1836	2293
Intragruppo y off-shore***	0	0	1861	727	0	0	1610	516	0	0	1005	398
Otros	83	27	403	747	125	51	578	1502	67	10	731	881
<b>Total</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>4391</b>	<b>4391</b>	<b>177</b>	<b>177</b>	<b>4746</b>	<b>4746</b>	<b>77</b>	<b>77</b>	<b>3573</b>	<b>3573</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.