

Fecha de Publicación: 10 de febrero de 2015

Fecha de Información: 06 de febrero 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\$1194,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.<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	209,7	203,9	59,2	87,0	54,7	32,7	90,0
15-35	314,4	360,1	338,9	193,0	18,2	118,4	3,0
36-60	2,4	2,8	0,0	0,0	2,8	2,4	0,0
61-90	5,0	34,5	30,0	0,0	4,5	5,0	0,0
91-180	5,5	122,6	115,0	1,4	7,6	4,1	0,0
>180	13,2	13,1	0,0	10,0	13,1	3,2	0,0
<b>Total</b>	<b>550,3</b>	<b>737,0</b>	<b>543,1</b>	<b>291,4</b>	<b>100,9</b>	<b>166,0</b>	<b>93,0</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	0,4 %	3,7 %	1,7 %	2,0 %
15-35	2,9 %	3,6 %	3,3 %	3,5 %
36-60	-	4,3 %	2,4 %	3,4 %
61-90	-	3,5 %	2,9 %	3,4 %
91-180	-	3,3 %	3,0 %	3,3 %
>180	-	3,3 %	3,2 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,1 %</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**

Sectores	2 al 6 de febrero				9 al 13 de febrero				16 al 20 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	66	3021	3279	50	86	2890	3816	27	93	2686	2540
Intragrupo y off-shore***	0	0	1706	1128	0	0	2339	1036	0	0	1481	883
Otros	66	15	631	951	86	50	681	1058	93	27	371	1115
<b>Total</b>	<b>81</b>	<b>81</b>	<b>5358</b>	<b>5358</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>5911</b>	<b>5911</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>4538</b>	<b>4538</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.