

Fecha de Publicación: 25 de febrero de 2015

Fecha de Información: 23 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\$1594,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	236,7	227,4	100,0	174,0	87,3	22,6	40,1
15-35	521,6	446,2	354,3	137,4	16,0	308,2	76,0
36-60	28,9	34,3	20,0	0,0	14,3	28,9	0,0
61-90	33,6	66,8	45,0	0,0	1,8	13,6	20,0
91-180	30,9	72,8	0,0	0,0	72,8	30,9	0,0
>180	21,4	9,8	0,0	0,0	9,8	21,4	0,0
<b>Total</b>	<b>873,0</b>	<b>857,2</b>	<b>519,3</b>	<b>311,4</b>	<b>201,8</b>	<b>425,6</b>	<b>136,1</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	-10,6 %	4,7 %	1,7 %	1,9 %
15-35	3,3 %	3,9 %	4,1 %	3,9 %
36-60	-	4,0 %	3,3 %	3,7 %
61-90	3,5 %	3,7 %	3,2 %	3,6 %
91-180	-	3,4 %	2,7 %	3,2 %
>180	-	3,7 %	1,8 %	2,4 %
<b>Total</b>	<b>-0,9 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,3 %</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	23 al 27 de febrero				2 al 6 de marzo				9 al 13 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	105	3271	4537	14	70	2495	2942	22	110	2144	3195
Intragrupo y off-shore***	0	0	2745	863	0	0	1750	843	0	0	2212	613
Otros	105	11	839	1456	70	14	489	949	110	22	521	1069
<b>Total</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>6856</b>	<b>6856</b>	<b>84</b>	<b>84</b>	<b>4735</b>	<b>4735</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>4877</b>	<b>4877</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.