

**Fecha de Publicación: 2 de marzo de 2015**

**Fecha de Información: 26 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\$1359,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.<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	271,7	211,1	123,6	178,0	22,5	28,7	65,0
15-35	419,7	505,9	324,7	147,0	16,2	107,7	165,0
36-60	4,3	32,0	0,0	0,0	32,0	4,3	0,0
61-90	20,8	29,0	0,0	0,0	9,0	0,8	20,0
91-180	23,7	87,8	0,0	0,0	65,8	1,7	22,0
>180	23,4	16,9	0,0	0,0	1,9	8,4	15,0
<b>Total</b>	<b>763,8</b>	<b>882,8</b>	<b>448,3</b>	<b>325,0</b>	<b>147,5</b>	<b>151,8</b>	<b>287,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,6 %	3,8 %	7,1 %	5,7 %
15-35	3,9 %	4,0 %	3,7 %	3,9 %
36-60	-	4,0 %	3,5 %	3,9 %
61-90	0,0 %	-34,7 %	3,4 %	-10,4 %
91-180	3,7 %	3,6 %	2,9 %	3,6 %
>180	3,4 %	3,8 %	2,9 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>5,4 %</b>	<b>4,0 %</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	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**	8	102	4238	4658	23	75	2655	3241	30	113	2381	3416
Intragruppo y off-shore***	0	0	2750	1703	0	0	1985	914	0	0	2257	639
Otros	102	8	865	1492	75	23	533	1018	113	30	611	1193
<b>Total</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>7853</b>	<b>7853</b>	<b>98</b>	<b>98</b>	<b>5173</b>	<b>5173</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>5249</b>	<b>5249</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 intragruppo.