

**Fecha de Publicación: 11 de marzo de 2015**

**Fecha de Información: 09 de marzo 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\$1,709 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.<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	470.1	175.2	83.9	361.7	21.3	38.3	70.0
15-35	315.1	527.3	467.6	82.8	44.8	217.3	15.0
36-60	10.4	15.0	0.0	0.0	15.0	10.4	0.0
61-90	4.8	3.5	0.0	0.0	3.5	4.8	0.0
91-180	63.4	139.7	50.0	0.0	89.7	63.4	0.0
>180	54.9	49.7	10.0	0.0	4.7	19.9	35.0
<b>Total</b>	<b>918.6</b>	<b>910.5</b>	<b>611.5</b>	<b>444.5</b>	<b>179.0</b>	<b>354.1</b>	<b>120.0</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	4.4 %	5.2 %	4.2 %	4.5 %
15-35	3.1 %	3.6 %	4.2 %	3.9 %
36-60	-	5.7 %	3.4 %	4.8 %
61-90	-	4.4 %	2.9 %	3.6 %
91-180	-	3.8 %	3.3 %	3.7 %
>180	3.6 %	-2.8 %	3.2 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>4.0 %</b>	<b>3.8 %</b>	<b>4.1 %</b>	<b>3.9 %</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	9 al 13 de marzo				16 al 20 de marzo				23 al 27 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	41	110	3490	4190	28	91	3637	4161	9	67	2054	2204
Intragruppo y off-shore***	0	0	2597	1244	3	0	2836	1320	0	0	1504	533
Otros	110	41	770	1424	88	28	379	1370	67	9	387	1208
<b>Total</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>6858</b>	<b>6858</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>6851</b>	<b>6851</b>	<b>76</b>	<b>76</b>	<b>3945</b>	<b>3945</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.