

**Fecha de Publicación: 16 de marzo de 2015**

**Fecha de Información: 12 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\$1,667 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.<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	509.7	531.9	332.6	322.8	79.4	66.9	120.0
15-35	324.9	262.8	200.5	128.0	12.8	147.5	49.5
36-60	7.7	10.3	0.0	0.0	10.3	7.7	0.0
61-90	0.6	11.3	0.0	0.0	11.3	0.6	0.0
91-180	32.2	126.9	15.0	0.0	111.9	32.2	0.0
>180	15.5	3.1	0.0	0.0	3.1	15.5	0.0
<b>Total</b>	<b>890.6</b>	<b>946.3</b>	<b>548.1</b>	<b>450.8</b>	<b>228.8</b>	<b>270.3</b>	<b>169.5</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	4.3 %	3.9 %	2.7 %	3.4 %
15-35	3.5 %	4.4 %	4.2 %	4.2 %
36-60	-	5.1 %	3.9 %	4.6 %
61-90	-	4.6 %	7.9 %	4.8 %
91-180	-	4.5 %	4.2 %	4.4 %
>180	-	4.4 %	3.8 %	3.9 %
<b>Total</b>	<b>4.1 %</b>	<b>4.2 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.8 %</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**	39	106	4262	4383	29	93	4077	4617	9	72	2179	2415
Intragruppo y off-shore***	0	0	2742	1929	3	0	3133	1632	0	0	1684	587
Otros	106	39	775	1467	91	29	421	1382	72	9	396	1257
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>7779</b>	<b>7779</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>7631</b>	<b>7631</b>	<b>81</b>	<b>81</b>	<b>4259</b>	<b>4259</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.