

Fecha de Publicación: 20 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 18 de noviembre de 2014 <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\$1914,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.<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	367,6	302,1	187,5	160,0	44,6	137,6	70,0
15-35	630,8	462,7	327,5	280,8	23,9	238,8	111,3
36-60	80,6	119,2	100,0	0,0	14,2	75,6	5,0
61-90	26,7	2,8	0,0	0,0	2,8	26,7	0,0
91-180	66,1	54,3	0,0	20,0	34,3	26,1	20,0
>180	0,9	7,1	0,0	0,0	7,1	0,9	0,0
<b>Total</b>	<b>1172,7</b>	<b>948,3</b>	<b>615,0</b>	<b>460,8</b>	<b>127,0</b>	<b>505,7</b>	<b>206,3</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	0,0 %	3,9 %	2,9 %	3,0 %
15-35	5,2 %	4,9 %	4,0 %	4,5 %
36-60	0,0 %	4,6 %	4,0 %	4,3 %
61-90	-	4,5 %	3,8 %	3,9 %
91-180	3,8 %	4,0 %	3,8 %	3,9 %
>180	-	4,2 %	3,0 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>3,2 %</b>	<b>4,5 %</b>	<b>3,7 %</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**

Sector	17 al 21 de noviembre				24 al 28 de noviembre				1 al 5 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	47	122	2952	3393	13	119	2869	4097	36	68	2568	4169
Intragrupo y off-shore***	0	0	2228	1292	0	0	2671	1116	0	0	2731	746
Otros	122	47	564	1060	119	13	742	1068	68	36	512	897
<b>Total</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>5745</b>	<b>5745</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>6281</b>	<b>6281</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>5812</b>	<b>5812</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.