

Fecha de Publicación: 26 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 24 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\$1268,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.<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	453,7	208,7	76,0	307,5	12,8	26,3	120,0
15-35	273,5	351,4	276,3	101,0	13,7	111,0	61,5
36-60	35,8	20,2	0,0	0,0	20,2	35,8	0,0
61-90	9,3	0,5	0,0	0,0	0,5	9,3	0,0
91-180	61,9	49,3	20,0	0,0	9,3	41,9	20,0
>180	0,4	5,0	0,0	0,0	5,0	0,4	0,0
<b>Total</b>	<b>834,5</b>	<b>635,2</b>	<b>372,3</b>	<b>408,5</b>	<b>61,5</b>	<b>224,6</b>	<b>201,5</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	0,9 %	4,2 %	1,9 %	2,0 %
15-35	2,8 %	3,0 %	3,2 %	3,0 %
36-60	-	3,8 %	3,2 %	3,4 %
61-90	-	4,3 %	3,2 %	3,3 %
91-180	3,2 %	3,6 %	3,3 %	3,3 %
>180	-	4,0 %	2,7 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>1,7 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>2,7 %</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	24 al 28 de noviembre				1 al 5 de diciembre				8 al 12 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	126	3823	4356	40	65	2777	4638	51	76	2293	2254
Intragruppo y off-shore***	0	0	2735	1826	0	0	2986	806	0	0	1338	667
Otros	126	18	792	1168	65	40	601	920	76	51	545	1254
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>7350</b>	<b>7350</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>6364</b>	<b>6364</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>4176</b>	<b>4176</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.