

**Fecha de Publicación: 2 de diciembre de 2014**

**Fecha de Información: 28 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\$1576,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	130,8	178,8	108,0	36,0	35,8	59,8	35,0
15-35	451,0	591,9	340,5	256,5	114,4	57,5	137,0
36-60	73,6	13,5	0,0	0,0	13,5	73,6	0,0
61-90	32,2	130,2	85,0	0,0	35,2	22,2	10,0
91-180	29,0	19,4	0,0	0,0	19,4	29,0	0,0
>180	36,9	71,3	60,0	0,0	11,3	36,9	0,0
<b>Total</b>	<b>753,5</b>	<b>1005,1</b>	<b>593,5</b>	<b>292,5</b>	<b>229,6</b>	<b>279,0</b>	<b>182,0</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	3,9 %	3,0 %	2,6 %	3,0 %
15-35	3,9 %	3,5 %	3,6 %	3,6 %
36-60	-	3,5 %	3,5 %	3,5 %
61-90	3,2 %	3,4 %	2,9 %	3,3 %
91-180	-	3,7 %	3,2 %	3,4 %
>180	-	3,6 %	3,1 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,9 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,4 %</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**	17	110	4160	4439	51	70	3131	4917	70	88	2533	2605
Intragruo y off-shore***	0	0	2746	2115	0	0	3044	901	0	0	1575	760
Otros	110	17	827	1178	70	51	708	1065	88	70	560	1303
<b>Total</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>7732</b>	<b>7732</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>6882</b>	<b>6882</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>4668</b>	<b>4668</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 intragruo.