

Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2014

Fecha de Información: 28 de octubre 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\$1341,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	125,2	110,6	45,0	85,5	42,6	16,7	23,0
15-35	491,7	264,3	181,3	396,5	33,0	45,2	50,0
36-60	53,3	41,6	23,0	50,0	18,6	3,3	0,0
61-90	3,5	41,7	0,4	0,0	41,3	3,5	0,0
91-180	20,0	121,8	10,0	20,0	111,8	0,0	0,0
>180	49,5	95,8	70,0	0,0	20,8	44,5	5,0
<b>Total</b>	<b>743,2</b>	<b>675,9</b>	<b>329,7</b>	<b>552,0</b>	<b>268,2</b>	<b>113,2</b>	<b>78,0</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	2,7 %	4,9 %	4,5 %	4,5 %
15-35	4,6 %	4,2 %	4,6 %	4,5 %
36-60	-	4,3 %	4,6 %	4,5 %
61-90	-	4,3 %	3,9 %	4,3 %
91-180	-	4,3 %	4,0 %	4,2 %
>180	3,9 %	4,0 %	3,8 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>4,0 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>4,5 %</b>	<b>4,4 %</b>

\* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	27 al 31 de octubre				3 al 7 de noviembre				10 al 14 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	46	117	3655	3672	13	82	2556	3280	28	91	1957	2484
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2183	1719	0	0	1966	831	0	0	1777	768
<b>Otros</b>	117	46	730	1178	82	13	480	891	91	28	385	867
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>6569</b>	<b>6569</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>5003</b>	<b>5003</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>4119</b>	<b>4119</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.