

Fecha de Publicación: 5 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 31 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\$1444,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.<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	158,0	61,1	40,0	60,0	21,1	98,0	0,0
15-35	362,2	686,5	358,6	97,8	129,6	66,2	198,3
36-60	28,2	36,7	21,3	0,0	14,2	26,9	1,3
61-90	10,9	17,0	0,0	0,0	17,0	10,9	0,0
91-180	130,9	81,7	15,0	64,0	22,7	22,9	44,0
>180	108,8	78,6	0,0	0,0	5,6	35,8	73,0
<b>Total</b>	<b>799,0</b>	<b>961,6</b>	<b>434,9</b>	<b>221,8</b>	<b>210,2</b>	<b>260,8</b>	<b>316,5</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	-	4,6 %	3,4 %	3,7 %
15-35	3,4 %	4,4 %	3,8 %	4,0 %
36-60	3,8 %	4,1 %	3,9 %	4,0 %
61-90	-	4,5 %	3,8 %	4,2 %
91-180	3,5 %	4,0 %	3,9 %	3,8 %
>180	3,9 %	4,1 %	4,1 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>4,3 %</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.

<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**

Sector	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	94	3774	3793	25	90	2862	3450	43	96	2048	2644
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2269	1822	0	0	2059	961	0	0	1884	768
<b>Otros</b>	94	46	765	1194	90	25	557	1069	96	43	423	942
<b>Total</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>6808</b>	<b>6808</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>5479</b>	<b>5479</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>4354</b>	<b>4354</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.