

Fecha de Publicación: 6 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 04 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\$1581,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.<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	413,7	358,2	106,0	63,7	9,2	106,9	243,0
15-35	271,8	518,3	475,3	111,5	19,4	136,8	23,5
36-60	16,7	11,9	3,6	0,0	8,2	16,7	0,0
61-90	46,1	8,7	0,0	0,0	8,7	46,1	0,0
91-180	129,4	12,5	0,0	46,3	12,5	83,1	0,0
>180	48,7	11,9	0,9	0,6	11,0	48,1	0,0
<b>Total</b>	<b>926,4</b>	<b>921,4</b>	<b>585,9</b>	<b>222,1</b>	<b>69,1</b>	<b>437,8</b>	<b>266,5</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	3,7 %	3,7 %	4,0 %	3,8 %
15-35	4,5 %	4,9 %	4,3 %	4,7 %
36-60	-	4,9 %	4,1 %	4,4 %
61-90	-	4,4 %	3,8 %	3,9 %
91-180	-	4,4 %	3,7 %	3,8 %
>180	-	4,3 %	3,8 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>4,2 %</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	3 al 7 de noviembre				10 al 14 de noviembre				17 al 21 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	93	3065	3677	46	95	2218	2746	36	104	2057	2409
Intragrupa y off-shore***	0	0	2139	1002	0	0	1884	778	0	0	1528	941
Otros	93	30	562	1087	95	46	425	1002	103	36	493	728
<b>Total</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>5766</b>	<b>5766</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>4527</b>	<b>4527</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>4079</b>	<b>4079</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.