

Fecha de Publicación: 7 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 05 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\$2602,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.<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	617,1	282,6	202,0	501,2	1,6	36,9	79,0
15-35	362,4	1055,4	892,2	136,0	32,2	95,4	131,0
36-60	8,5	5,9	0,0	0,0	5,9	8,5	0,0
61-90	23,2	4,5	0,0	0,0	4,5	23,2	0,0
91-180	185,7	251,8	10,1	5,0	111,7	50,7	130,0
>180	105,1	60,2	40,0	52,9	0,2	32,2	20,0
<b>Total</b>	<b>1302,0</b>	<b>1660,5</b>	<b>1144,3</b>	<b>695,1</b>	<b>156,2</b>	<b>246,9</b>	<b>360,0</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	5,9 %	3,4 %	4,1 %	4,1 %
15-35	4,7 %	4,7 %	4,4 %	4,7 %
36-60	-	4,7 %	4,0 %	4,3 %
61-90	-	4,4 %	4,0 %	4,0 %
91-180	3,4 %	4,2 %	3,8 %	3,8 %
>180	3,8 %	3,8 %	3,7 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>4,5 %</b>	<b>4,4 %</b>	<b>4,1 %</b>	<b>4,3 %</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	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
<b>Sector Financiero**</b>	29	92	3564	3767	46	101	2318	2900	36	103	2115	2484
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2216	1483	0	0	1989	793	0	0	1589	946
<b>Otros</b>	92	29	561	1089	101	46	422	1035	103	36	495	769
<b>Total</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>6340</b>	<b>6340</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>4729</b>	<b>4729</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>4200</b>	<b>4200</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.