

Fecha de Publicación: 11 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 07 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\$1114,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.<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	208,1	108,3	55,0	67,0	7,3	95,1	46,0
15-35	257,6	385,0	342,4	108,0	5,6	112,6	37,0
36-60	43,0	6,2	0,0	34,0	6,2	9,0	0,0
61-90	33,2	32,0	10,0	0,0	22,0	33,2	0,0
91-180	45,4	36,3	10,0	10,0	11,3	20,4	15,0
>180	55,0	12,4	0,0	0,0	2,4	45,0	10,0
<b>Total</b>	<b>642,3</b>	<b>580,3</b>	<b>417,4</b>	<b>219,0</b>	<b>54,9</b>	<b>315,3</b>	<b>108,0</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	0,0 %	2,5 %	4,1 %	3,1 %
15-35	1,8 %	5,1 %	4,7 %	4,7 %
36-60	-	5,3 %	4,6 %	4,7 %
61-90	-	3,9 %	3,8 %	3,9 %
91-180	3,9 %	3,8 %	3,6 %	3,7 %
>180	3,8 %	-1,5 %	3,3 %	3,1 %
<b>Total</b>	<b>1,5 %</b>	<b>4,5 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,1 %</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	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	97	3671	3787	52	109	2541	3144	38	110	2411	2691
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2233	1589	0	0	2123	875	0	0	1716	972
<b>Otros</b>	97	29	564	1091	109	52	421	1066	110	38	495	959
<b>Total</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>6467</b>	<b>6467</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>5085</b>	<b>5085</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>4622</b>	<b>4622</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.