

Fecha de Publicación: 18 de noviembre de 2014

Fecha de Información: 13 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\$1276,7 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	122,3	132,3	114,5	94,5	17,8	27,8	0,0
15-35	336,3	477,9	380,0	97,5	21,9	162,8	76,0
36-60	3,2	8,4	0,0	0,0	8,4	3,2	0,0
61-90	90,1	22,8	0,2	0,0	2,6	70,1	20,0
91-180	48,8	70,2	30,0	0,0	20,2	28,8	20,0
>180	29,6	72,5	20,0	0,0	30,8	7,9	21,7
<b>Total</b>	<b>630,3</b>	<b>784,1</b>	<b>544,7</b>	<b>192,0</b>	<b>101,7</b>	<b>300,6</b>	<b>137,7</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	-	5,0 %	3,3 %	4,2 %
15-35	4,5 %	3,4 %	4,5 %	4,0 %
36-60	-	4,9 %	3,7 %	4,6 %
61-90	4,3 %	7,0 %	3,9 %	4,1 %
91-180	1,9 %	3,5 %	3,6 %	3,2 %
>180	3,7 %	3,9 %	3,5 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>4,0 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,0 %</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**

Sectores	10 al 14 de noviembre				17 al 21 de noviembre				24 al 28 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	39	103	3333	3211	47	119	2651	3223	11	102	2750	3909
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2147	1585	0	0	2116	1074	0	0	2562	1116
<b>Otros</b>	103	39	444	1128	118	47	532	1003	101	11	723	1010
<b>Total</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>5924</b>	<b>5924</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>5299</b>	<b>5299</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>6035</b>	<b>6035</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.