

Fecha de Publicación: 14 de octubre de 2014

Fecha de Información: 08 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\$2538,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	382,9	440,1	357,0	282,5	63,1	80,4	20,0
15-35	561,5	932,0	575,5	192,9	157,8	169,8	198,8
36-60	22,7	8,8	0,0	0,0	8,8	22,7	0,0
61-90	29,6	15,5	0,0	0,0	15,5	29,6	0,0
91-180	249,0	130,4	30,0	30,0	25,4	144,0	75,0
>180	35,5	44,2	12,0	0,0	12,2	15,5	20,0
<b>Total</b>	<b>1281,2</b>	<b>1571,1</b>	<b>974,5</b>	<b>505,4</b>	<b>282,9</b>	<b>462,0</b>	<b>313,8</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,0 %	4,0 %	3,8 %	3,9 %
15-35	4,0 %	4,2 %	3,9 %	4,1 %
36-60	-	4,2 %	3,2 %	3,5 %
61-90	-	4,0 %	3,6 %	3,7 %
91-180	3,8 %	4,0 %	3,8 %	3,8 %
>180	3,8 %	4,0 %	3,3 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>4,0 %</b>	<b>4,1 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,0 %</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	6 al 10 de octubre				13 al 17 de octubre				20 al 24 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	40	137	4805	4802	40	132	3095	3048	36	161	2451	3294
Intragruppo y off-shore***	0	0	3011	1996	0	0	1900	1411	0	0	2137	950
Otros	137	40	679	1697	132	40	330	867	161	36	591	934
<b>Total</b>	<b>177</b>	<b>177</b>	<b>8494</b>	<b>8494</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>5326</b>	<b>5326</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>5179</b>	<b>5179</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 intragruppo.