

Fecha de Publicación: 16 de octubre de 2014

Fecha de Información: 14 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\$1050,5 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	199,4	191,5	122,7	92,4	18,8	57,0	50,0
15-35	155,0	310,5	230,9	45,5	17,6	47,5	62,0
36-60	24,2	121,3	98,8	0,0	12,5	14,2	10,0
61-90	1,7	5,6	0,0	0,0	5,6	1,7	0,0
91-180	63,5	68,1	0,0	54,1	68,1	9,4	0,0
>180	14,6	17,1	0,8	2,0	16,3	12,6	0,0
<b>Total</b>	<b>458,3</b>	<b>714,2</b>	<b>453,2</b>	<b>194,0</b>	<b>138,9</b>	<b>142,3</b>	<b>122,0</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	2,9 %	4,7 %	3,7 %	4,0 %
15-35	4,6 %	4,8 %	4,5 %	4,7 %
36-60	4,0 %	4,6 %	4,0 %	4,2 %
61-90	-	4,4 %	2,9 %	4,0 %
91-180	-	4,3 %	3,9 %	4,2 %
>180	-	4,2 %	3,7 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>4,0 %</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**

Sectores	13 al 17 de octubre				20 al 24 de octubre				27 al 31 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	39	149	3410	3429	38	193	2587	3475	47	98	2577	2489
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2139	1573	0	0	2279	996	0	0	1275	1175
<b>Otros</b>	149	39	336	883	193	38	604	999	98	47	616	803
<b>Total</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>5886</b>	<b>5886</b>	<b>231</b>	<b>231</b>	<b>5470</b>	<b>5470</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>4468</b>	<b>4468</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.