

Fecha de Publicación: 21 de octubre de 2014

Fecha de Información: 17 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\$887,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.<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	251,9	152,1	60,0	45,0	52,1	166,9	40,0
15-35	202,0	250,8	197,5	95,5	43,3	96,5	10,0
36-60	2,3	10,5	0,0	0,0	10,5	2,3	0,0
61-90	16,5	10,6	0,0	15,0	10,6	1,5	0,0
91-180	1,1	16,9	0,0	0,0	16,9	1,1	0,0
>180	2,6	20,7	0,0	0,0	20,7	2,6	0,0
<b>Total</b>	<b>476,3</b>	<b>461,6</b>	<b>257,5</b>	<b>155,5</b>	<b>154,1</b>	<b>270,8</b>	<b>50,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,2 %	4,9 %	4,2 %	4,2 %
15-35	4,7 %	4,6 %	3,3 %	4,1 %
36-60	-	4,6 %	4,0 %	4,5 %
61-90	-	4,8 %	3,5 %	4,7 %
91-180	-	3,7 %	3,6 %	3,7 %
>180	-	-12,7 %	3,2 %	-11,0 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,7 %</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	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
Sector Financiero**	37	165	3607	3512	43	196	2925	3898	47	100	2866	2734
Intragruppo y off-shore***	0	0	2139	1712	0	0	2421	1061	0	0	1422	1208
Otros	165	37	369	892	196	43	759	1146	100	47	633	979
<b>Total</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>6116</b>	<b>6116</b>	<b>240</b>	<b>240</b>	<b>6105</b>	<b>6105</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>4922</b>	<b>4922</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.