

Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2014

Fecha de Información: 20 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\$1760,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	415,7	409,3	353,0	311,0	5,3	53,7	51,0
15-35	344,5	489,7	389,0	205,0	6,5	45,3	94,3
36-60	35,6	4,0	0,0	0,0	4,0	35,6	0,0
61-90	2,7	3,2	0,0	0,0	3,2	2,7	0,0
91-180	95,6	130,0	4,5	42,0	85,5	13,6	40,0
>180	2,4	12,8	0,0	0,0	12,8	2,4	0,0
<b>Total</b>	<b>896,5</b>	<b>1049,0</b>	<b>746,5</b>	<b>558,0</b>	<b>117,2</b>	<b>153,3</b>	<b>185,3</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	13,9 %	4,3 %	3,1 %	4,4 %
15-35	4,6 %	4,7 %	4,5 %	4,6 %
36-60	-	5,2 %	4,1 %	4,3 %
61-90	-	4,4 %	4,0 %	4,2 %
91-180	4,0 %	4,3 %	4,0 %	4,2 %
>180	-	4,2 %	3,5 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>7,0 %</b>	<b>4,4 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,5 %</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	20 al 24 de octubre				27 al 31 de octubre				3 al 7 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	195	3262	3989	48	100	2945	3054	11	81	2316	2823
Intragrupo y off-shore***	0	0	2468	1344	0	0	1729	1236	0	0	1696	757
Otros	195	44	766	1162	100	48	633	1016	80	11	420	852
<b>Total</b>	<b>239</b>	<b>239</b>	<b>6495</b>	<b>6495</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>5307</b>	<b>5307</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>4432</b>	<b>4432</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.