

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2014

Fecha de Información: 21 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\$1642,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,7%.<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	346,3	316,2	228,0	256,5	40,7	42,3	47,5
15-35	586,6	399,2	232,0	273,5	29,7	175,6	137,5
36-60	27,9	30,5	0,0	0,0	20,5	17,9	10,0
61-90	10,1	10,0	0,0	0,0	10,0	10,1	0,0
91-180	49,8	54,4	0,0	0,0	29,4	24,8	25,0
>180	24,5	10,8	0,0	20,0	6,8	0,5	4,0
<b>Total</b>	<b>1045,4</b>	<b>821,0</b>	<b>460,0</b>	<b>550,0</b>	<b>137,0</b>	<b>271,4</b>	<b>224,0</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	2,7 %	5,7 %	10,7 %	7,8 %
15-35	3,9 %	4,7 %	4,4 %	4,4 %
36-60	4,2 %	5,4 %	4,0 %	4,7 %
61-90	-	3,6 %	3,9 %	3,7 %
91-180	3,9 %	4,6 %	4,0 %	4,2 %
>180	4,0 %	4,7 %	3,9 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>5,2 %</b>	<b>6,8 %</b>	<b>5,7 %</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	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	194	3544	4073	47	109	3007	3260	11	81	2377	2889
Intragrupa y off-shore***	0	0	2498	1580	0	0	1911	1257	0	0	1751	796
Otros	194	44	786	1176	108	47	642	1043	81	11	422	864
<b>Total</b>	<b>239</b>	<b>239</b>	<b>6829</b>	<b>6829</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>5561</b>	<b>5561</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>4550</b>	<b>4550</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 intragrupo.