

Fecha de Publicación: 20 de agosto de 2014

Fecha de Información: 15 de agosto 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\$1191,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.<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	262,1	183,1	110,5	75,5	2,6	116,6	70,0
15-35	269,3	448,8	327,0	78,0	56,3	125,8	65,5
36-60	12,2	34,3	10,0	0,0	24,3	12,2	0,0
61-90	8,2	6,5	0,0	0,0	6,5	8,2	0,0
91-180	32,0	49,2	30,0	0,0	19,2	32,0	0,0
>180	6,3	21,1	0,0	0,0	15,1	0,3	6,0
<b>Total</b>	<b>590,1</b>	<b>743,0</b>	<b>477,5</b>	<b>153,5</b>	<b>124,0</b>	<b>295,1</b>	<b>141,5</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	3,7 %	4,0 %	3,1 %	3,4 %
15-35	3,7 %	3,6 %	3,8 %	3,7 %
36-60	-	4,0 %	3,7 %	3,9 %
61-90	-	8,9 %	3,0 %	5,6 %
91-180	-	8,1 %	3,8 %	6,4 %
>180	4,2 %	4,3 %	3,2 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,9 %</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	11 al 15 de agosto				18 al 22 de agosto				25 al 29 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	24	123	3893	3808	13	114	2968	2813	11	134	2491	3247
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	5	0	2241	1332	0	0	1671	1038	0	0	1814	579
<b>Otros</b>	118	24	631	1624	114	13	538	1326	134	11	851	1331
<b>Total</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>6764</b>	<b>6764</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>5177</b>	<b>5177</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>5157</b>	<b>5157</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.