

Fecha de Publicación: 28 de agosto de 2014

Fecha de Información: 26 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\$1066,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.<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	136,3	100,2	72,5	90,2	10,7	29,1	17,0
15-35	384,9	370,4	129,0	153,0	129,4	119,9	112,0
36-60	32,8	9,9	0,0	20,0	9,9	12,8	0,0
61-90	2,5	20,3	0,0	0,0	20,3	2,5	0,0
91-180	20,8	28,5	11,8	0,0	16,7	20,8	0,0
>180	61,4	87,1	0,0	0,0	27,1	1,4	60,0
<b>Total</b>	<b>638,7</b>	<b>616,4</b>	<b>213,3</b>	<b>263,2</b>	<b>214,1</b>	<b>186,5</b>	<b>189,0</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	3,8 %	4,9 %	3,5 %	4,1 %
15-35	4,4 %	4,4 %	3,9 %	4,2 %
36-60	-	4,7 %	4,0 %	4,3 %
61-90	-	4,8 %	3,8 %	4,7 %
91-180	-	4,2 %	4,0 %	4,1 %
>180	2,4 %	4,7 %	3,8 %	3,1 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>4,5 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,1 %</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	25 al 29 de agosto				1 al 5 de septiembre				8 al 12 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	20	137	3692	4034	10	76	2197	2358	12	137	2514	2221
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2132	1110	0	0	1385	459	0	0	1356	761
<b>Otros</b>	137	20	938	1617	76	10	262	1026	137	12	335	1223
<b>Total</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>6761</b>	<b>6761</b>	<b>86</b>	<b>86</b>	<b>3843</b>	<b>3843</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>4204</b>	<b>4204</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.