

Fecha de Publicación: 9 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 05 de septiembre 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\$1049,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.<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	158,2	182,9	71,0	25,5	39,9	60,7	72,0
15-35	415,1	314,2	138,0	162,0	20,2	97,1	156,0
36-60	10,1	1,9	0,0	0,0	1,9	10,1	0,0
61-90	66,2	56,8	0,0	0,0	16,8	26,2	40,0
91-180	1,0	29,1	15,0	0,0	14,1	1,0	0,0
>180	43,7	78,0	30,0	0,0	8,0	3,7	40,0
<b>Total</b>	<b>694,3</b>	<b>663,0</b>	<b>254,0</b>	<b>187,5</b>	<b>101,0</b>	<b>198,8</b>	<b>308,0</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 %	4,6 %	4,5 %	4,3 %
15-35	4,5 %	4,5 %	4,4 %	4,4 %
36-60	-	4,8 %	4,1 %	4,2 %
61-90	2,9 %	4,7 %	4,2 %	3,7 %
91-180	-	4,5 %	3,8 %	4,5 %
>180	4,1 %	4,2 %	3,9 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>4,1 %</b>	<b>4,5 %</b>	<b>4,4 %</b>	<b>4,3 %</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**

Sectores	1 al 5 de septiembre				8 al 12 de septiembre				15 al 19 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	88	2878	2855	36	143	3301	3164	123	101	2299	3287
Intragrupa y off-shore***	0	0	1604	813	0	2	1893	1043	4	0	2130	758
Otros	88	19	355	1168	143	34	444	1431	97	123	589	972
<b>Total</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>4837</b>	<b>4837</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>5638</b>	<b>5638</b>	<b>223</b>	<b>223</b>	<b>5018</b>	<b>5018</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.