

Fecha de Publicación: 15 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 11 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\$1575,6 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	460,2	397,9	300,4	291,0	11,5	83,2	86,0
15-35	375,4	362,7	275,4	161,5	19,2	145,9	68,0
36-60	7,5	7,4	0,0	0,0	7,4	7,5	0,0
61-90	1,8	26,1	20,0	0,0	6,1	1,8	0,0
91-180	18,5	28,9	10,0	2,4	18,9	16,0	0,0
>180	16,6	31,8	20,0	0,0	6,8	11,6	5,0
<b>Total</b>	<b>879,9</b>	<b>854,7</b>	<b>625,8</b>	<b>454,9</b>	<b>69,9</b>	<b>265,9</b>	<b>159,0</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	4,5 %	4,4 %	2,8 %	3,6 %
15-35	5,1 %	4,9 %	4,1 %	4,6 %
36-60	-	5,1 %	4,5 %	4,8 %
61-90	-	3,0 %	3,6 %	3,0 %
91-180	-	4,7 %	4,2 %	4,5 %
>180	0,0 %	4,3 %	4,0 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>4,7 %</b>	<b>4,6 %</b>	<b>3,5 %</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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sector	8 al 12 de septiembre												15 al 19 de septiembre				22 al 26 de septiembre			
	Delivery				NDF				Delivery		NDF		Delivery		NDF					
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V						
<b>Sector Financiero**</b>	38	155	3913	3547	126	105	2920	3871	13	130	3214	3200								
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	2	2125	1515	4	0	2489	1036	0	0	1917	843								
<b>Otros</b>	155	36	490	1466	101	126	622	1123	130	13	551	1640								
<b>Total</b>	<b>193</b>	<b>193</b>	<b>6528</b>	<b>6528</b>	<b>230</b>	<b>230</b>	<b>6031</b>	<b>6031</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>5683</b>	<b>5683</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.