

Fecha de Publicación: 17 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 15 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\$2228,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.<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	448,6	301,8	205,0	336,3	16,7	32,2	80,1
15-35	687,0	293,6	104,1	417,0	36,5	117,0	153,0
36-60	137,5	130,5	125,0	111,0	5,5	26,5	0,0
61-90	9,7	55,8	0,0	5,0	55,8	4,7	0,0
91-180	108,9	327,9	271,0	50,0	11,9	13,9	45,0
>180	1,0	4,2	0,0	0,0	4,2	1,0	0,0
<b>Total</b>	<b>1392,7</b>	<b>1113,8</b>	<b>705,1</b>	<b>919,3</b>	<b>130,6</b>	<b>195,3</b>	<b>278,1</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	3,9 %	3,2 %	2,7 %	3,1 %
15-35	4,8 %	5,0 %	3,1 %	3,7 %
36-60	-	2,9 %	4,3 %	3,1 %
61-90	-	4,9 %	3,4 %	4,8 %
91-180	4,4 %	4,6 %	4,3 %	4,4 %
>180	-	4,9 %	3,5 %	4,7 %
<b>Total</b>	<b>4,5 %</b>	<b>3,7 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,6 %</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	15 al 19 de septiembre												22 al 26 de septiembre						29 de sep. al 3 de octubre					
	Delivery				NDF				Delivery				NDF				Delivery				NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V						
Sector Financiero**	66	127	3735	4208	19	137	3478	3548	39	81	1909	2287												
Intragrupa y off-shore***	4	0	2755	1553	0	0	2173	1000	0	0	1233	781												
Otros	123	66	626	1355	137	19	554	1657	81	39	465	540												
<b>Total</b>	<b>193</b>	<b>193</b>	<b>7116</b>	<b>7116</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>6205</b>	<b>6205</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>3607</b>	<b>3607</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.