

Fecha de Publicación: 29 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 25 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\$1681,3 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	457,1	132,3	54,0	323,0	29,8	85,6	48,5
15-35	458,9	418,6	333,0	168,0	33,1	238,4	52,5
36-60	30,0	2,3	0,0	0,0	2,3	30,0	0,0
61-90	38,5	58,4	10,0	10,2	38,4	18,3	10,0
91-180	31,1	76,5	0,0	0,2	76,5	30,9	0,0
>180	26,9	61,7	50,0	7,2	11,7	19,7	0,0
<b>Total</b>	<b>1042,4</b>	<b>749,9</b>	<b>447,0</b>	<b>508,5</b>	<b>191,9</b>	<b>422,9</b>	<b>111,0</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	4,1 %	4,6 %	3,1 %	3,4 %
15-35	4,6 %	4,4 %	4,5 %	4,5 %
36-60	-	4,8 %	4,0 %	4,0 %
61-90	4,7 %	4,6 %	4,3 %	4,5 %
91-180	-	4,5 %	4,1 %	4,4 %
>180	-	4,1 %	3,8 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>4,4 %</b>	<b>4,4 %</b>	<b>3,9 %</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	22 al 26 de septiembre				29 de sep. al 3 de octubre				6 al 10 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	57	158	4470	4316	39	98	2613	2883	57	118	2842	3391
<b>Intragrupoy off-shore***</b>	0	0	2604	1517	0	0	1501	976	0	0	2296	906
<b>Otros</b>	158	57	682	1923	98	39	614	870	118	57	551	1392
<b>Total</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>7756</b>	<b>7756</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>4728</b>	<b>4728</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>5689</b>	<b>5689</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.