

Fecha de Publicación: 30 de septiembre de 2014

Fecha de Información: 26 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\$1304,2 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	324,8	221,3	96,0	199,1	55,3	55,7	70,0
15-35	442,0	209,4	125,4	234,5	11,0	134,5	73,0
36-60	21,1	89,4	70,0	0,0	19,4	21,1	0,0
61-90	11,0	17,7	0,1	0,0	17,5	11,0	0,0
91-180	13,8	61,0	38,5	0,5	22,5	13,3	0,0
>180	12,7	25,0	10,0	0,4	13,0	10,3	2,0
<b>Total</b>	<b>825,4</b>	<b>623,7</b>	<b>340,0</b>	<b>434,5</b>	<b>138,8</b>	<b>245,9</b>	<b>145,0</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	4,3 %	4,5 %	3,8 %	4,1 %
15-35	4,5 %	4,0 %	4,2 %	4,2 %
36-60	-	4,4 %	4,1 %	4,3 %
61-90	-	0,5 %	4,1 %	1,9 %
91-180	-	3,1 %	3,9 %	3,3 %
>180	4,0 %	4,3 %	3,6 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>4,4 %</b>	<b>4,1 %</b>	<b>4,0 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^\wedge (360/Plazo)) - 1$ . 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	156	4465	4329	46	89	2787	2962	65	121	2977	3527
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2604	1517	0	0	1527	1101	0	0	2366	980
<b>Otros</b>	156	57	695	1918	89	46	647	899	121	65	568	1404
<b>Total</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>7764</b>	<b>7764</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>4961</b>	<b>4961</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>5911</b>	<b>5911</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.