

Fecha de Publicación: 1 de octubre de 2014

Fecha de Información: 29 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\$1454,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.<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	267,7	250,3	115,9	84,6	10,4	59,2	124,0
15-35	626,3	243,5	106,1	445,3	9,4	53,1	128,0
36-60	68,3	136,9	115,0	0,1	1,9	48,2	20,0
61-90	6,9	25,2	0,0	0,0	21,2	2,9	4,0
91-180	16,2	26,1	20,0	0,1	6,1	16,1	0,0
>180	40,7	42,2	20,0	10,0	2,2	10,7	20,0
<b>Total</b>	<b>1026,1</b>	<b>724,2</b>	<b>376,9</b>	<b>540,0</b>	<b>51,2</b>	<b>190,1</b>	<b>296,0</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	3,4 %	6,9 %	3,7 %	4,6 %
15-35	3,5 %	4,4 %	4,1 %	4,0 %
36-60	4,1 %	4,4 %	4,2 %	4,3 %
61-90	4,1 %	4,4 %	3,9 %	4,3 %
91-180	-	4,3 %	3,8 %	4,1 %
>180	3,9 %	4,0 %	3,8 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>5,1 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>4,2 %</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	29 de sep. al 3 de octubre				6 al 10 de octubre				13 al 17 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	55	87	2943	3124	66	125	3080	3614	27	115	2469	1981
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1619	1176	0	0	2390	990	0	0	1184	1177
<b>Otros</b>	87	55	647	909	125	66	577	1442	115	27	221	715
<b>Total</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>5209</b>	<b>5209</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>6046</b>	<b>6046</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>3873</b>	<b>3873</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.