

Fecha de Publicación: 7 de octubre de 2014

Fecha de Información: 03 de octubre 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\$1520,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	465,7	328,4	139,0	290,0	42,7	29,0	146,7
15-35	298,8	519,9	385,0	128,0	53,9	89,8	81,0
36-60	1,3	16,9	13,0	0,0	3,9	1,3	0,0
61-90	21,1	18,1	15,1	0,0	3,0	21,1	0,0
91-180	29,9	37,4	0,0	0,4	37,4	29,5	0,0
>180	7,9	2,9	0,0	0,0	2,9	7,9	0,0
<b>Total</b>	<b>824,7</b>	<b>923,6</b>	<b>552,1</b>	<b>418,4</b>	<b>143,8</b>	<b>178,6</b>	<b>227,7</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	3,5 %	3,7 %	2,9 %	3,3 %
15-35	3,4 %	2,9 %	2,6 %	2,9 %
36-60	-	4,7 %	3,1 %	4,5 %
61-90	-	3,9 %	3,5 %	3,7 %
91-180	-	1,7 %	3,6 %	2,6 %
>180	-	4,0 %	3,4 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>3,1 %</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	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	C	V	C	V	C	V						
Sector Financiero**	55	95	3304	3281	78	131	3940	4306	32	121	2755	2332												
Intragrupo y off-shore***	0	0	1672	1449	0	0	2730	1396	0	0	1358	1288												
Otros	95	55	681	926	131	78	655	1623	121	32	237	729												
<b>Total</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>5657</b>	<b>5657</b>	<b>209</b>	<b>209</b>	<b>7325</b>	<b>7325</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>4349</b>	<b>4349</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.