

**Fecha de Publicación: 1 de septiembre de 2014**

**Fecha de Información: 28 de agosto 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\$1394,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.<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	254,8	120,8	56,5	178,1	22,3	34,7	42,0
15-35	402,9	452,7	332,1	156,3	34,1	160,2	86,5
36-60	22,5	5,0	0,0	0,0	5,0	22,5	0,0
61-90	8,6	50,8	0,0	0,0	50,8	8,6	0,0
91-180	147,6	52,1	40,0	0,0	12,0	147,5	0,2
>180	2,3	2,8	0,0	0,3	2,8	2,0	0,0
<b>Total</b>	<b>838,7</b>	<b>684,2</b>	<b>428,6</b>	<b>334,6</b>	<b>126,9</b>	<b>375,4</b>	<b>128,7</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	
3-14	3,0 %	4,3 %	2,4 %	3,0 %
15-35	4,0 %	3,5 %	4,1 %	3,8 %
36-60	-	4,5 %	3,8 %	3,9 %
61-90	-	4,4 %	4,0 %	4,3 %
91-180	4,2 %	4,2 %	4,0 %	4,1 %
>180	-	4,7 %	3,4 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,7 %</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	25 al 29 de agosto				1 al 5 de septiembre				8 al 12 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	19	127	4335	4233	18	77	2322	2438	13	134	2676	2561
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2218	1644	0	0	1417	500	0	0	1619	827
Otros	127	19	962	1638	77	18	271	1071	134	13	347	1254
Total	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>7515</b>	<b>7515</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>4009</b>	<b>4009</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>4642</b>	<b>4642</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.