

**Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2014**

**Fecha de Información: 08 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\$1309,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.<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	307,4	348,8	196,5	122,5	12,3	44,9	140,0
15-35	207,1	336,3	284,0	27,0	19,3	147,1	33,0
36-60	11,3	7,3	0,0	0,0	7,3	11,3	0,0
61-90	92,0	65,1	0,0	0,0	65,1	92,0	0,0
91-180	79,0	9,5	0,0	0,0	9,5	79,0	0,0
>180	14,9	3,6	0,0	0,0	3,6	14,9	0,0
<b>Total</b>	<b>711,8</b>	<b>770,6</b>	<b>480,5</b>	<b>149,5</b>	<b>117,1</b>	<b>389,3</b>	<b>173,0</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	4,5 %	4,6 %	4,0 %	4,4 %
15-35	4,6 %	4,7 %	4,2 %	4,5 %
36-60	-	4,9 %	3,9 %	4,3 %
61-90	-	4,6 %	4,2 %	4,4 %
91-180	-	5,1 %	4,0 %	4,1 %
>180	-	4,5 %	3,9 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>4,5 %</b>	<b>4,6 %</b>	<b>4,1 %</b>	<b>4,4 %</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**

Sectores	8 al 12 de septiembre				15 al 19 de septiembre				22 al 26 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	149	3513	3356	123	100	2394	3449	13	116	3032	2872
Intragrupo y off-shore***	0	2	1999	1166	4	0	2220	758	0	0	1607	826
Otros	149	34	455	1445	96	123	595	1002	116	13	544	1486
<b>Total</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>5967</b>	<b>5967</b>	<b>223</b>	<b>223</b>	<b>5209</b>	<b>5209</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>5183</b>	<b>5183</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.