

**Fecha de Publicación: 15 de mayo de 2014**

**Fecha de Información: 13 de mayo 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\$1415,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.<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	287,9	186,8	67,0	129,2	20,8	59,8	99,0
15-35	357,3	308,0	199,2	190,9	9,9	67,5	99,0
36-60	8,4	10,9	7,7	0,0	3,2	8,4	0,0
61-90	74,2	91,9	0,0	0,0	91,1	73,4	0,8
91-180	112,1	179,0	40,0	0,0	99,0	72,1	40,0
>180	19,0	18,8	10,0	0,0	8,8	19,0	0,0
<b>Total</b>	<b>858,9</b>	<b>795,4</b>	<b>323,9</b>	<b>320,0</b>	<b>232,8</b>	<b>300,1</b>	<b>238,8</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	2,8 %	3,0 %	2,6 %	2,8 %
15-35	2,9 %	3,5 %	2,7 %	3,0 %
36-60	-	4,5 %	3,0 %	3,4 %
61-90	3,4 %	3,6 %	3,0 %	3,3 %
91-180	3,1 %	3,4 %	3,2 %	3,3 %
>180	-	4,2 %	3,6 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,4 %</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	12 al 16 de mayo				19 al 23 de mayo				26 al 30 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	48	141	3189	3341	19	134	3402	3744	14	105	2089	2453
Intragrupa y off-shore***	0	0	1626	981	5	0	2208	1278	0	0	1109	680
Otros	141	48	719	1211	129	19	537	1125	104	14	795	860
<b>Total</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>5534</b>	<b>5534</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>6147</b>	<b>6147</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>3993</b>	<b>3993</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.