

**Fecha de Publicación: 20 de mayo de 2014**

**Fecha de Información: 16 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\$1218,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	381,1	257,0	40,0	173,2	43,0	33,9	174,0
15-35	239,8	435,0	226,1	26,3	66,9	71,5	142,0
36-60	42,0	83,0	20,0	0,0	23,0	2,0	40,0
61-90	10,0	11,9	0,0	5,0	11,9	5,0	0,0
91-180	70,2	23,9	0,0	10,0	13,8	50,1	10,1
>180	15,0	30,4	7,0	0,0	8,4	0,0	15,0
<b>Total</b>	<b>758,0</b>	<b>841,2</b>	<b>293,1</b>	<b>214,4</b>	<b>167,0</b>	<b>162,5</b>	<b>381,1</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,4 %	3,5 %	1,9 %	2,4 %
15-35	1,4 %	2,6 %	2,3 %	2,2 %
36-60	0,0 %	2,7 %	2,2 %	1,4 %
61-90	-	2,9 %	2,1 %	2,7 %
91-180	3,2 %	3,6 %	2,9 %	3,1 %
>180	3,8 %	2,8 %	-	3,3 %
<b>Total</b>	<b>1,9 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>2,2 %</b>	<b>2,3 %</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**	49	140	3422	3427	22	128	3920	4150	18	110	2506	3035		
Intragruppo y off-shore***	0	0	1626	1126	5	0	2332	1516	0	0	1393	781		
Otros	140	49	725	1220	123	22	607	1192	110	18	856	939		
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>5774</b>	<b>5774</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>6858</b>	<b>6858</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>4756</b>	<b>4756</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 intragruppo.