

**Fecha de Publicación: 21 de mayo de 2014**

**Fecha de Información: 19 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\$883,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.<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	158,2	105,7	77,0	142,0	28,7	16,2	0,0
15-35	222,2	354,8	224,5	86,0	19,0	24,9	111,3
36-60	17,0	34,2	10,0	0,0	14,2	7,0	10,0
61-90	7,9	11,0	0,0	0,0	11,0	7,9	0,0
91-180	30,8	81,4	25,1	1,2	31,4	4,6	25,0
>180	3,3	3,0	0,0	0,0	3,0	3,3	0,0
<b>Total</b>	<b>439,4</b>	<b>590,2</b>	<b>336,6</b>	<b>229,2</b>	<b>107,3</b>	<b>63,9</b>	<b>146,3</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	-	2,9 %	1,5 %	2,2 %
15-35	1,9 %	2,7 %	1,9 %	2,3 %
36-60	1,7 %	2,5 %	2,5 %	2,3 %
61-90	-	3,5 %	2,9 %	3,3 %
91-180	3,2 %	3,3 %	3,2 %	3,3 %
>180	-	4,2 %	3,2 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>2,1 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>1,8 %</b>	<b>2,4 %</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	19 al 23 de mayo				26 al 30 de mayo				2 al 6 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	115	4023	4211	19	110	2560	3088	5	63	1506	1550
Intragruppo y off-shore***	0	0	2374	1608	0	0	1433	831	0	0	838	570
Otros	115	24	626	1203	110	19	869	942	63	5	298	523
<b>Total</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>7022</b>	<b>7022</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>4861</b>	<b>4861</b>	<b>68</b>	<b>68</b>	<b>2643</b>	<b>2643</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 intragruppo.