

**Fecha de Publicación: 28 de mayo de 2014**

**Fecha de Información: 26 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\$172,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.<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	60,2	43,3	38,0	38,0	5,3	22,2	0,0
15-35	3,4	3,1	0,0	0,0	3,1	3,4	0,0
36-60	3,8	7,8	7,0	0,0	0,8	3,8	0,0
61-90	9,4	4,9	0,0	0,0	4,9	9,4	0,0
91-180	10,2	23,3	0,0	0,0	23,3	10,2	0,0
>180	0,0	3,5	0,0	0,0	3,5	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>87,0</b>	<b>85,9</b>	<b>45,0</b>	<b>38,0</b>	<b>40,9</b>	<b>49,0</b>	<b>0,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	5,1 %	6,0 %	5,6 %
15-35	-	3,4 %	2,4 %	2,8 %
36-60	-	2,7 %	3,5 %	3,0 %
61-90	-	10,3 %	3,0 %	5,5 %
91-180	-	3,4 %	2,9 %	3,2 %
>180	-	4,1 %	-	4,1 %
<b>Total</b>	-	<b>4,6 %</b>	<b>4,9 %</b>	<b>4,7 %</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	26 al 30 de mayo				2 al 6 de junio				9 al 13 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	112	3132	3559	5	65	1685	1768	62	83	2089	2066
Intragruppo y off-shore***	0	0	1675	1074	0	0	965	621	0	0	1157	935
Otros	112	24	930	1104	65	5	303	564	83	62	403	648
<b>Total</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>5737</b>	<b>5737</b>	<b>70</b>	<b>70</b>	<b>2953</b>	<b>2953</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>3649</b>	<b>3649</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.