

**Fecha de Publicación: 4 de junio de 2014**

**Fecha de Información: 30 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\$1398,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.<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	327,6	310,1	84,0	128,0	55,1	28,6	171,0
15-35	256,0	475,2	214,0	169,5	233,2	58,5	28,0
36-60	23,0	41,4	1,0	0,0	17,9	0,5	22,5
61-90	0,4	50,3	0,0	0,0	50,3	0,4	0,0
91-180	70,7	50,1	5,3	1,4	44,5	69,1	0,2
>180	5,9	14,8	1,9	0,9	7,8	0,0	5,0
<b>Total</b>	<b>683,6</b>	<b>942,0</b>	<b>306,2</b>	<b>299,8</b>	<b>409,0</b>	<b>157,1</b>	<b>226,7</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	2,8 %	3,4 %	2,2 %	2,8 %
15-35	2,8 %	2,6 %	1,6 %	2,3 %
36-60	2,8 %	3,4 %	2,3 %	3,0 %
61-90	-	3,4 %	2,5 %	3,4 %
91-180	3,6 %	3,8 %	2,7 %	3,2 %
>180	3,4 %	4,1 %	3,8 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>2,8 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>2,0 %</b>	<b>2,6 %</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**	28	112	3959	3836	23	67	2079	2137	64	90	2576	2629
Intragruppo y off-shore***	0	0	1799	1632	0	0	1154	784	0	0	1336	1017
Otros	111	28	939	1229	67	23	334	646	90	64	442	708
<b>Total</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>6696</b>	<b>6696</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>3567</b>	<b>3567</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>4354</b>	<b>4354</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.