

**Fecha de Publicación: 12 de junio de 2014**

**Fecha de Información: 10 de junio 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\$1071,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	133,9	298,2	212,8	54,5	13,4	7,4	72,0
15-35	349,0	255,8	139,0	164,5	18,8	86,5	98,0
36-60	39,1	16,1	0,0	0,0	10,1	33,1	6,0
61-90	1,1	6,9	0,0	0,0	6,9	1,1	0,0
91-180	77,1	71,3	0,0	0,0	36,3	42,1	35,0
>180	20,8	23,3	0,0	10,0	13,3	0,8	10,0
<b>Total</b>	<b>621,0</b>	<b>671,7</b>	<b>351,8</b>	<b>229,0</b>	<b>98,9</b>	<b>171,0</b>	<b>221,0</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	3,0 %	3,3 %	3,0 %	3,2 %
15-35	3,7 %	3,6 %	3,3 %	3,4 %
36-60	3,5 %	4,4 %	3,3 %	3,6 %
61-90	-	4,4 %	3,1 %	4,2 %
91-180	3,7 %	4,1 %	3,5 %	3,7 %
>180	3,9 %	4,1 %	3,8 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,4 %</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**

Sector	9 al 13 de junio				16 al 20 de junio				23 al 27 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	110	84	3082	3206	18	106	3005	3514	11	92	2248	2573
Intragruppo y off-shore***	0	1	1723	1282	0	0	1829	1087	0	0	1219	862
Otros	84	109	468	785	106	18	575	807	92	11	724	755
<b>Total</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>5273</b>	<b>5273</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>5409</b>	<b>5409</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>4190</b>	<b>4190</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.