

**Fecha de Publicación: 19 de junio de 2014**

**Fecha de Información: 17 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\$1308,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	94,8	94,0	57,6	43,5	9,4	24,3	27,0
15-35	391,6	414,8	303,5	135,5	61,4	206,1	50,0
36-60	60,0	84,5	20,0	0,3	34,5	29,7	30,0
61-90	45,2	10,0	1,7	0,0	6,8	43,7	1,5
91-180	130,9	65,8	43,7	20,0	22,1	110,9	0,0
>180	12,8	22,0	0,0	0,0	12,0	2,8	10,0
<b>Total</b>	<b>735,3</b>	<b>691,2</b>	<b>426,5</b>	<b>199,3</b>	<b>146,2</b>	<b>417,5</b>	<b>118,5</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,5 %	4,3 %	2,5 %	3,4 %
15-35	3,8 %	3,9 %	2,6 %	3,2 %
36-60	3,9 %	4,0 %	3,5 %	3,8 %
61-90	3,6 %	4,1 %	3,5 %	3,6 %
91-180	-	3,8 %	3,7 %	3,7 %
>180	4,0 %	4,4 %	3,8 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>3,0 %</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	16 al 20 de junio				23 al 27 de junio				30 de jun. al 4 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	126	3467	3790	15	96	2394	2898	3	67	1121	1684
Intragrupo y off-shore***	0	0	1961	1371	0	0	1428	899	0	0	1057	290
Otros	126	25	599	866	96	15	784	810	67	3	233	437
<b>Total</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>6028</b>	<b>6028</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>4607</b>	<b>4607</b>	<b>70</b>	<b>70</b>	<b>2411</b>	<b>2411</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 intragrupo.