

**Fecha de Publicación: 25 de junio de 2014**

**Fecha de Información: 20 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\$1197,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.<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	364,0	178,7	146,0	281,5	10,7	60,5	22,0
15-35	178,5	283,1	201,0	70,8	34,1	59,8	48,0
36-60	91,4	36,8	3,3	0,0	3,1	61,0	30,4
61-90	35,6	13,1	0,0	0,0	13,1	35,6	0,0
91-180	43,0	95,2	0,0	5,0	57,2	0,0	38,0
>180	7,0	15,1	0,0	1,0	9,1	0,0	6,0
<b>Total</b>	<b>719,5</b>	<b>622,1</b>	<b>350,3</b>	<b>358,3</b>	<b>127,4</b>	<b>216,9</b>	<b>144,4</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	3,6 %	3,2 %	2,0 %	2,5 %
15-35	3,5 %	3,6 %	3,6 %	3,6 %
36-60	3,7 %	4,4 %	3,5 %	3,6 %
61-90	-	5,9 %	3,5 %	4,2 %
91-180	3,7 %	4,4 %	3,8 %	4,1 %
>180	4,0 %	4,5 %	-	4,3 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,7 %</b>	<b>2,6 %</b>	<b>3,2 %</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	130	3839	3911	22	93	2832	3139	4	68	1348	1830
Intragruppo y off-shore***	0	0	2001	1676	0	0	1598	1220	0	0	1074	324
Otros	130	25	630	883	93	22	806	877	67	4	235	503
<b>Total</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>6470</b>	<b>6470</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>5236</b>	<b>5236</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>2657</b>	<b>2657</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.