

**Fecha de Publicación: 8 de julio de 2014**

**Fecha de Información: 04 de julio 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\$26,0 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	3,9	0,8	0,0	0,0	0,8	3,9	0,0
15-35	0,5	10,2	8,0	0,0	2,2	0,5	0,0
36-60	0,4	0,4	0,0	0,0	0,4	0,4	0,0
61-90	0,0	1,5	0,0	0,0	1,5	0,0	0,0
91-180	0,0	6,8	0,0	0,0	6,8	0,0	0,0
>180	0,8	0,7	0,0	0,0	0,7	0,8	0,0
<b>Total</b>	<b>5,6</b>	<b>20,4</b>	<b>8,0</b>	<b>0,0</b>	<b>12,4</b>	<b>5,6</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	-	4,5 %	0,5 %	1,2 %
15-35	-	3,9 %	0,8 %	3,3 %
36-60	-	4,7 %	2,3 %	3,5 %
61-90	-	4,9 %	-	4,9 %
91-180	-	4,1 %	-	4,1 %
>180	-	4,4 %	3,2 %	3,7 %
<b>Total</b>	-	<b>4,2 %</b>	<b>1,0 %</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	30 de jun. al 4 de julio				7 al 11 de julio				14 al 18 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	58	2074	2140	29	76	2422	2664	13	147	1565	2046
Intragruppo y off-shore***	0	0	1219	771	0	1	1437	1036	0	0	1133	530
Otros	58	7	268	649	75	28	531	690	147	13	535	658
<b>Total</b>	<b>65</b>	<b>65</b>	<b>3560</b>	<b>3560</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>4389</b>	<b>4389</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>3234</b>	<b>3234</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.