

Fecha de Publicación: 16 de julio de 2014

Fecha de Información: 14 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\$1012,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	250,2	287,2	106,0	31,0	6,0	44,0	175,3
15-35	251,9	279,5	176,5	78,0	15,0	85,9	88,0
36-60	72,2	27,5	20,0	0,0	7,5	72,2	0,0
61-90	2,6	10,5	0,0	0,0	10,5	2,6	0,0
91-180	27,5	43,5	0,0	20,0	43,5	7,5	0,0
>180	20,2	13,2	0,0	10,0	3,2	0,2	10,0
<b>Total</b>	<b>624,5</b>	<b>661,3</b>	<b>302,5</b>	<b>139,0</b>	<b>85,6</b>	<b>212,3</b>	<b>273,3</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	3,8 %	4,0 %	2,8 %	3,6 %
15-35	3,9 %	4,0 %	3,7 %	3,8 %
36-60	-	4,0 %	3,5 %	3,7 %
61-90	-	4,1 %	3,7 %	4,0 %
91-180	-	4,2 %	3,9 %	4,1 %
>180	4,2 %	4,4 %	4,1 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,8 %</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	14 al 18 de julio				21 al 25 de julio				28 de jul. al 1 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	140	2185	2636	12	182	2006	2334	46	119	1992	2908
Intragrupa y off-shore***	0	0	1380	742	0	0	927	395	0	0	1806	842
Otros	140	16	585	772	182	12	475	679	119	46	552	600
<b>Total</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>4151</b>	<b>4151</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>3408</b>	<b>3408</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>4350</b>	<b>4350</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 intragrupo.