

Fecha de Publicación: 17 de julio de 2014

Fecha de Información: 15 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\$1463,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	184,5	274,6	166,3	50,0	14,3	40,5	94,0
15-35	342,5	423,4	386,4	103,0	10,0	212,5	27,0
36-60	22,8	10,9	0,0	0,0	10,9	22,8	0,0
61-90	152,8	64,8	0,0	150,0	64,8	2,8	0,0
91-180	34,9	22,5	0,0	0,0	22,5	34,9	0,0
>180	36,1	14,7	10,0	5,0	4,7	31,1	0,0
<b>Total</b>	<b>773,5</b>	<b>810,8</b>	<b>562,6</b>	<b>308,0</b>	<b>127,2</b>	<b>344,5</b>	<b>121,0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,3 %	3,5 %	2,0 %	3,4 %
15-35	4,1 %	3,2 %	2,5 %	2,9 %
36-60	-	7,1 %	3,6 %	4,8 %
61-90	-	4,3 %	3,2 %	3,5 %
91-180	-	4,4 %	3,7 %	4,0 %
>180	-	4,2 %	3,8 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>3,3 %</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	2257	2694	12	189	2068	2443	46	120	2098	3047
Intragrupa y off-shore***	0	0	1420	790	0	0	985	395	0	0	1913	887
Otros	140	16	594	785	189	12	470	686	120	46	555	633
<b>Total</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>4270</b>	<b>4270</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>3523</b>	<b>3523</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>4566</b>	<b>4566</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.