

Fecha de Publicación: 25 de julio de 2014

Fecha de Información: 23 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\$928,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.<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	164,2	198,7	74,8	88,3	88,9	40,9	35,0
15-35	156,5	255,0	208,5	59,4	18,5	69,1	28,0
36-60	8,7	6,9	0,0	0,0	6,6	8,4	0,3
61-90	130,4	27,0	0,0	50,5	27,0	79,9	0,0
91-180	1,3	29,0	0,0	0,0	28,2	0,5	0,8
>180	0,4	14,3	0,1	0,0	14,2	0,4	0,0
<b>Total</b>	<b>461,4</b>	<b>530,9</b>	<b>283,4</b>	<b>198,2</b>	<b>183,4</b>	<b>199,1</b>	<b>64,1</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	3,6 %	3,8 %	2,9 %	3,4 %
15-35	3,7 %	3,7 %	3,5 %	3,6 %
36-60	4,0 %	4,3 %	3,4 %	3,8 %
61-90	-	4,1 %	3,5 %	3,6 %
91-180	4,1 %	4,3 %	3,8 %	4,3 %
>180	-	4,1 %	3,2 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,6 %</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	21 al 25 de julio				28 de jul. al 1 de agosto				4 al 8 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	193	2853	3155	47	126	2678	3811	7	83	2396	2642
Intragrupa y off-shore***	0	0	1315	821	0	0	2254	1083	0	0	1483	558
Otros	193	18	554	745	126	47	769	807	83	7	386	1065
<b>Total</b>	<b>211</b>	<b>211</b>	<b>4722</b>	<b>4722</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>5701</b>	<b>5701</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>4265</b>	<b>4265</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.