

**Fecha de Publicación: 29 de julio de 2014**

**Fecha de Información: 25 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\$1017,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	252,5	230,4	192,8	174,0	7,6	48,5	30,0
15-35	128,9	325,8	265,0	48,0	9,8	29,9	51,0
36-60	16,4	28,8	24,0	0,0	4,8	16,4	0,0
61-90	0,9	32,5	0,0	0,0	32,5	0,9	0,0
91-180	20,4	29,1	0,0	0,0	29,1	20,4	0,0
>180	0,0	32,9	0,0	0,0	32,9	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>419,1</b>	<b>679,5</b>	<b>481,8</b>	<b>222,0</b>	<b>116,7</b>	<b>116,1</b>	<b>81,0</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	3,9 %	3,0 %	2,4 %	2,7 %
15-35	3,9 %	4,0 %	3,6 %	3,9 %
36-60	-	4,7 %	3,5 %	3,8 %
61-90	-	4,5 %	3,6 %	4,4 %
91-180	-	5,0 %	3,9 %	4,6 %
>180	-	4,3 %	-	4,3 %
<b>Total</b>	<b>3,9 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>3,5 %</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	192	2876	3170	50	133	3006	3964	32	78	2477	2880
Intragrupo y off-shore***	0	0	1325	844	0	0	2372	1334	0	0	1671	558
Otros	192	18	558	746	133	50	775	854	78	32	386	1096
<b>Total</b>	<b>210</b>	<b>210</b>	<b>4759</b>	<b>4759</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>6152</b>	<b>6152</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>4533</b>	<b>4533</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 intragrupo.