

**Fecha de Publicación: 4 de agosto de 2014**

**Fecha de Información: 31 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\$1339,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.<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	250,3	336,6	116,6	65,3	63,4	28,4	156,6
15-35	308,6	427,2	196,0	146,8	160,2	90,8	71,0
36-60	77,4	12,5	0,0	0,0	12,5	77,4	0,0
61-90	79,5	34,3	0,0	0,0	19,3	64,5	15,0
91-180	14,5	14,6	0,0	0,0	12,8	12,7	1,8
>180	17,8	25,3	5,0	0,8	5,3	2,0	15,0
<b>Total</b>	<b>748,1</b>	<b>850,5</b>	<b>317,6</b>	<b>212,9</b>	<b>273,5</b>	<b>275,8</b>	<b>259,4</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	4,0 %	4,0 %	2,1 %	3,7 %
15-35	3,8 %	4,3 %	2,9 %	3,8 %
36-60	-	4,2 %	3,6 %	3,7 %
61-90	3,9 %	4,5 %	3,6 %	3,8 %
91-180	4,1 %	4,3 %	3,5 %	3,9 %
>180	4,0 %	4,4 %	3,8 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>4,0 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>3,1 %</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	28 de jul. al 1 de agosto				4 al 8 de agosto				11 al 15 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	125	3637	4201	46	78	2866	3431	21	109	2710	2683
Intragruppo y off-shore***	0	0	2508	1834	0	1	1826	627	0	0	1503	559
Otros	125	33	799	908	78	45	535	1169	109	21	421	1393
<b>Total</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>6943</b>	<b>6943</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>5227</b>	<b>5227</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>4635</b>	<b>4635</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 intragruppo.