

**Fecha de Publicación: 5 de agosto de 2014**

**Fecha de Información: 01 de agosto 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\$827,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.<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	180,0	203,4	118,7	70,0	24,7	50,0	60,0
15-35	203,6	254,7	159,5	80,0	19,2	47,6	76,0
36-60	21,7	9,2	0,0	0,0	9,2	21,7	0,0
61-90	2,9	10,2	0,0	0,0	10,2	2,9	0,0
91-180	0,9	17,5	0,6	0,0	16,9	0,9	0,0
>180	46,8	57,4	0,8	0,0	11,6	1,8	45,0
<b>Total</b>	<b>455,9</b>	<b>552,2</b>	<b>279,5</b>	<b>150,0</b>	<b>91,6</b>	<b>124,9</b>	<b>181,0</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	3,1 %	-3,4 %	4,0 %	0,8 %
15-35	3,9 %	4,1 %	3,7 %	3,9 %
36-60	-	7,4 %	3,6 %	4,7 %
61-90	-	4,4 %	3,5 %	4,2 %
91-180	-	4,4 %	3,4 %	4,3 %
>180	4,1 %	4,2 %	3,8 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>1,6 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>2,8 %</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**	32	123	3651	4214	47	80	2979	3525	22	111	2761	2777
Intragrupo y off-shore***	0	0	2508	1834	0	1	1874	687	0	0	1574	569
Otros	123	32	811	923	80	45	541	1182	111	22	425	1414
<b>Total</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>6970</b>	<b>6970</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>5394</b>	<b>5394</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>4760</b>	<b>4760</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.