

**Fecha de Publicación: 13 de agosto de 2014**

**Fecha de Información: 11 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\$855,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.<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	226,2	213,2	77,9	115,0	39,2	15,2	96,0
15-35	325,4	149,1	81,0	172,7	8,1	92,7	60,0
36-60	29,9	7,8	0,0	0,0	7,8	29,9	0,0
61-90	3,6	13,6	5,0	0,0	8,6	3,6	0,0
91-180	0,0	17,8	0,0	0,0	17,8	0,0	0,0
>180	17,1	7,8	0,0	15,0	7,8	2,1	0,0
<b>Total</b>	<b>602,2</b>	<b>409,3</b>	<b>164,0</b>	<b>302,7</b>	<b>89,4</b>	<b>143,4</b>	<b>156,0</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 %	4,3 %	3,2 %	3,6 %
15-35	3,9 %	3,9 %	3,7 %	3,8 %
36-60	-	4,5 %	3,7 %	3,9 %
61-90	-	4,6 %	4,0 %	4,4 %
91-180	-	4,7 %	-	4,7 %
>180	-	4,4 %	4,0 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>3,6 %</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	11 al 15 de agosto				18 al 22 de agosto				25 al 29 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	122	3317	3661	12	100	2569	2090	11	125	2196	2932
Intragrupo y off-shore***	5	0	2202	854	0	0	1156	924	0	0	1581	503
Otros	116	25	611	1615	100	12	459	1171	125	11	782	1124
<b>Total</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>6130</b>	<b>6130</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>4185</b>	<b>4185</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>4559</b>	<b>4559</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.