

**Fecha de Publicación: 18 de julio de 2014**

**Fecha de Información: 16 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\$1406,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	387,9	414,2	245,2	243,0	64,0	39,9	105,0
15-35	243,6	352,8	271,1	113,5	11,1	59,5	70,6
36-60	2,7	30,3	0,0	0,0	30,3	2,7	0,0
61-90	0,2	72,8	0,0	0,0	72,8	0,2	0,0
91-180	11,1	30,5	0,0	0,0	30,5	11,1	0,0
>180	30,8	25,2	0,1	0,0	5,1	10,8	20,0
<b>Total</b>	<b>676,4</b>	<b>925,9</b>	<b>516,4</b>	<b>356,5</b>	<b>213,9</b>	<b>124,3</b>	<b>195,6</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 intragruo		Total
		Compras/Ventas	Compras	Ventas
3-14	0,6 %	4,0 %	3,9 %	3,3 %
15-35	2,3 %	4,2 %	4,0 %	3,7 %
36-60	-	4,4 %	3,7 %	4,4 %
61-90	-	4,3 %	3,3 %	4,3 %
91-180	-	4,3 %	3,9 %	4,2 %
>180	4,1 %	4,4 %	3,9 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>1,6 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>3,9 %</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**

Sectores	14 al 18 de julio				21 al 25 de julio				28 de jul. al 1 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	142	2462	2748	14	186	2201	2714	46	120	2173	3144
Intragruo y off-shore***	0	0	1462	983	0	0	1138	445	0	0	1964	887
Otros	141	16	595	787	186	14	534	714	120	46	561	667
<b>Total</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>4518</b>	<b>4518</b>	<b>200</b>	<b>200</b>	<b>3873</b>	<b>3873</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>4697</b>	<b>4697</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.