

**Fecha de Publicación: 21 de julio de 2014**

**Fecha de Información: 17 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\$969,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.<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	210,7	223,3	114,0	85,0	27,3	43,7	82,0
15-35	173,1	208,5	135,6	81,0	63,1	82,1	9,9
36-60	13,4	1,6	0,0	0,0	1,6	13,4	0,0
61-90	6,0	62,9	0,0	0,0	62,9	6,0	0,0
91-180	28,4	6,4	0,0	10,0	6,4	18,4	0,0
>180	66,2	96,3	57,0	30,0	4,3	1,2	35,0
<b>Total</b>	<b>497,9</b>	<b>599,0</b>	<b>306,6</b>	<b>206,0</b>	<b>165,5</b>	<b>164,9</b>	<b>126,9</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	2,0 %	4,4 %	3,2 %	3,2 %
15-35	3,9 %	4,9 %	3,8 %	4,4 %
36-60	-	4,9 %	3,9 %	4,0 %
61-90	-	4,4 %	3,9 %	4,4 %
91-180	-	4,7 %	3,8 %	4,0 %
>180	4,1 %	4,0 %	3,9 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>4,6 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,9 %</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**	18	144	2492	2749	17	184	2325	2813	46	120	2237	3267
Intragrupo y off-shore***	0	0	1462	1012	0	0	1172	494	0	0	2044	894
Otros	144	18	596	788	184	17	544	734	120	46	577	697
<b>Total</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>4550</b>	<b>4550</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>4041</b>	<b>4041</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>4857</b>	<b>4857</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 intragrupo.