

**Fecha de Publicación: 23 de julio de 2014**

**Fecha de Información: 21 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\$1572,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.<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	310,9	217,6	52,0	159,0	52,9	39,2	112,7
15-35	440,0	430,2	288,5	286,5	21,7	33,5	120,0
36-60	39,5	43,4	1,2	0,0	12,2	9,5	30,0
61-90	109,0	30,8	0,0	0,0	15,8	94,0	15,0
91-180	42,7	155,9	52,8	0,0	73,1	12,7	30,0
>180	2,5	57,7	0,0	0,0	57,7	2,5	0,0
<b>Total</b>	<b>944,7</b>	<b>935,6</b>	<b>394,5</b>	<b>445,5</b>	<b>233,4</b>	<b>191,5</b>	<b>307,7</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	3,0 %	3,0 %	3,0 %	3,0 %
15-35	3,6 %	3,8 %	3,3 %	3,5 %
36-60	3,8 %	4,7 %	3,5 %	4,0 %
61-90	3,7 %	4,2 %	3,4 %	3,6 %
91-180	3,7 %	4,2 %	3,4 %	4,0 %
>180	-	4,1 %	2,7 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,7 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,5 %</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	21 al 25 de julio				28 de jul. al 1 de agosto				4 al 8 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	185	2700	3088	46	125	2398	3354	7	81	2248	2520
Intragrupo y off-shore***	0	0	1285	712	0	0	2072	965	0	0	1480	497
Otros	185	18	559	744	125	46	618	769	81	7	313	1025
<b>Total</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>4544</b>	<b>4544</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>5088</b>	<b>5088</b>	<b>88</b>	<b>88</b>	<b>4041</b>	<b>4041</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.