

**Fecha de Publicación: 30 de julio de 2014**

**Fecha de Información: 28 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\$851,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.<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	179,1	67,8	42,0	136,5	9,3	26,1	16,5
15-35	175,9	260,6	172,5	112,1	74,1	49,9	14,0
36-60	23,1	46,8	40,0	0,0	6,0	22,4	0,8
61-90	0,4	9,9	0,0	0,0	9,9	0,4	0,0
91-180	15,4	23,2	0,0	0,0	22,1	14,3	1,1
>180	31,3	50,7	46,5	31,2	4,2	0,1	0,0
<b>Total</b>	<b>425,2</b>	<b>458,9</b>	<b>301,0</b>	<b>279,8</b>	<b>125,6</b>	<b>113,1</b>	<b>32,4</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	
3-14	0,6 %	4,1 %	2,1 %	2,4 %
15-35	3,9 %	4,1 %	4,0 %	4,0 %
36-60	4,0 %	4,0 %	3,8 %	3,9 %
61-90	-	4,3 %	3,5 %	4,3 %
91-180	3,9 %	4,4 %	3,6 %	4,1 %
>180	-	4,2 %	4,3 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>2,2 %</b>	<b>4,1 %</b>	<b>3,2 %</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	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**	52	133	3157	3996	32	78	2495	2913	10	100	2549	2567
Intragrupo y off-shore***	0	0	2385	1456	0	0	1700	573	0	0	1450	495
Otros	133	52	777	867	78	32	390	1099	100	10	404	1341
<b>Total</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>6319</b>	<b>6319</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>4585</b>	<b>4585</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>4403</b>	<b>4403</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.