

**Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2014**

**Fecha de Información: 12 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\$1470,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	195,3	359,2	158,5	60,0	94,5	29,1	106,1
15-35	371,3	291,8	158,0	192,0	86,8	132,3	47,0
36-60	88,8	89,0	50,0	0,0	9,0	58,8	30,0
61-90	91,2	25,4	0,0	0,0	25,4	91,2	0,0
91-180	52,7	76,3	47,0	20,0	27,4	30,7	2,0
>180	7,6	7,4	0,0	0,0	7,4	7,6	0,0
<b>Total</b>	<b>806,8</b>	<b>849,2</b>	<b>413,5</b>	<b>272,0</b>	<b>250,5</b>	<b>349,7</b>	<b>185,1</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	
3-14	2,5 %	4,1 %	3,1 %	3,4 %
15-35	3,9 %	3,8 %	2,2 %	3,0 %
36-60	4,1 %	2,5 %	3,6 %	3,4 %
61-90	-	4,2 %	3,6 %	3,7 %
91-180	4,1 %	4,1 %	3,8 %	4,0 %
>180	-	4,1 %	3,3 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>3,3 %</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	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	121	3441	3750	12	102	2640	2329	11	132	2261	3039
Intragruo y off-shore***	5	0	2223	909	0	0	1294	928	0	0	1636	514
Otros	116	25	614	1618	102	12	520	1196	132	11	833	1178
<b>Total</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>6277</b>	<b>6277</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>4454</b>	<b>4454</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>4731</b>	<b>4731</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.