

**Fecha de Publicación: 25 de agosto de 2014**

**Fecha de Información: 21 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\$1396,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.<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	323,5	281,1	147,5	98,5	21,6	113,0	112,0
15-35	445,1	354,6	199,3	149,0	77,3	218,1	78,0
36-60	8,8	17,5	12,0	0,0	5,5	8,8	0,0
61-90	1,4	54,8	50,0	0,0	4,8	1,4	0,0
91-180	6,9	15,4	0,3	0,0	15,1	6,9	0,0
>180	39,1	69,9	25,0	0,8	13,5	7,0	31,4
<b>Total</b>	<b>824,8</b>	<b>793,2</b>	<b>434,1</b>	<b>248,3</b>	<b>137,7</b>	<b>355,2</b>	<b>221,4</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	1,7 %	4,5 %	2,9 %	3,2 %
15-35	4,1 %	4,2 %	4,0 %	4,1 %
36-60	-	7,0 %	3,6 %	4,9 %
61-90	-	4,2 %	1,9 %	4,1 %
91-180	-	4,5 %	3,1 %	4,1 %
>180	4,1 %	4,2 %	2,9 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,7 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	18 al 22 de agosto				25 al 29 de agosto				1 al 5 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	12	113	3470	3077	20	142	2929	3571	6	77	1830	2080
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1890	1481	0	0	1969	692	0	0	1211	459
Otros	113	12	545	1347	142	20	924	1558	77	6	257	760
Total	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>5905</b>	<b>5905</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>5822</b>	<b>5822</b>	<b>84</b>	<b>84</b>	<b>3298</b>	<b>3298</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.