

Fecha de Publicación: 27 de febrero de 2014

Fecha de Información: 25 de febrero 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\$1716,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	513,7	435,9	391,8	348,0	2,1	123,7	42,0
15-35	246,5	407,1	342,0	117,5	8,1	72,0	57,0
36-60	5,7	31,9	30,0	0,0	1,9	5,7	0,0
61-90	44,0	7,6	0,0	0,0	3,6	40,0	4,0
91-180	52,0	46,9	0,0	0,0	46,9	52,0	0,0
>180	24,6	18,7	0,0	0,0	3,7	9,6	15,0
<b>Total</b>	<b>886,5</b>	<b>948,0</b>	<b>763,8</b>	<b>465,5</b>	<b>66,3</b>	<b>303,0</b>	<b>118,0</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	0,7 %	1,7 %	0,8 %	1,1 %
15-35	2,9 %	1,5 %	1,3 %	1,6 %
36-60	-	1,9 %	1,4 %	1,9 %
61-90	2,3 %	2,4 %	2,1 %	2,2 %
91-180	-	2,5 %	2,1 %	2,3 %
>180	3,0 %	3,3 %	2,7 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>2,1 %</b>	<b>1,7 %</b>	<b>1,1 %</b>	<b>1,4 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	24 al 28 de febrero				3 al 7 de marzo				10 al 14 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	24	128	4657	4954	22	88	3252	3425	14	189	2203	2109
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2915	2148	0	0	2362	1434	0	0	1240	872
<b>Otros</b>	128	24	720	1190	88	22	485	1240	189	14	556	1019
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>8292</b>	<b>8292</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>6098</b>	<b>6098</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>3999</b>	<b>3999</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.