

Fecha de Publicación: 3 de marzo de 2014

Fecha de Información: 27 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\$1889,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,6%.<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	416,7	322,0	81,0	33,0	20,0	162,7	221,0
15-35	338,5	549,1	362,5	145,8	40,6	46,7	146,0
36-60	7,0	3,7	0,0	1,9	3,7	5,0	0,0
61-90	128,0	397,4	68,4	0,0	261,9	61,0	67,0
91-180	37,8	82,8	0,0	0,0	62,8	17,8	20,0
>180	53,1	7,4	0,0	30,0	7,4	23,1	0,0
<b>Total</b>	<b>981,0</b>	<b>1362,5</b>	<b>511,9</b>	<b>210,7</b>	<b>396,5</b>	<b>316,2</b>	<b>454,0</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	0,4 %	0,4 %	1,6 %	0,9 %
15-35	1,1 %	1,7 %	1,3 %	1,5 %
36-60	-	2,6 %	1,1 %	1,6 %
61-90	1,9 %	2,5 %	1,8 %	2,3 %
91-180	1,2 %	2,8 %	1,8 %	2,3 %
>180	-	3,2 %	2,8 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>0,9 %</b>	<b>2,0 %</b>	<b>1,6 %</b>	<b>1,6 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . 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>	21	106	4793	5009	28	91	3386	3645	16	190	2684	2399
<b>Intragrupoy off-shore***</b>	0	0	2933	2271	0	0	2491	1446	0	0	1300	881
<b>Otros</b>	106	21	758	1203	91	28	496	1282	190	16	559	1264
<b>Total</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>8484</b>	<b>8484</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>6372</b>	<b>6372</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>4543</b>	<b>4543</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.