

Fecha de Publicación: 4 de marzo de 2014

Fecha de Información: 28 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\$1329,3 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	300,2	173,4	74,0	155,6	27,4	72,6	72,0
15-35	449,2	439,6	207,0	243,0	133,6	107,2	99,0
36-60	2,0	18,8	0,0	0,0	18,8	2,0	0,0
61-90	0,3	20,0	0,0	0,0	20,0	0,3	0,0
91-180	15,4	64,0	50,0	10,0	14,0	5,4	0,0
>180	8,0	9,5	0,0	0,0	9,5	8,0	0,0
<b>Total</b>	<b>775,1</b>	<b>725,2</b>	<b>331,0</b>	<b>408,6</b>	<b>223,2</b>	<b>195,4</b>	<b>171,0</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	1,2 %	2,7 %	1,1 %	1,5 %
15-35	1,3 %	1,7 %	1,3 %	1,5 %
36-60	-	2,5 %	1,4 %	2,4 %
61-90	-	2,8 %	1,6 %	2,8 %
91-180	-	2,4 %	2,1 %	2,4 %
>180	-	3,3 %	2,5 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>1,3 %</b>	<b>2,1 %</b>	<b>1,3 %</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.

**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
Sector Financiero**	22	104	4793	5012	33	93	3602	3774	18	190	2759	2446
Intragrupa y off-shore***	0	0	2933	2271	0	1	2555	1600	0	0	1310	881
Otros	104	22	760	1203	93	32	509	1292	190	18	577	1319
<b>Total</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>8486</b>	<b>8486</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>6666</b>	<b>6666</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>4645</b>	<b>4645</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.