

**Fecha de Publicación: 17 de marzo de 2014**

**Fecha de Información: 13 de marzo 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\$1843,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.<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         | 527,4               | 335,9         | 149,8                     | 265,8        | 20,1          | 95,6         | 166,0          |
| 15-35        | 370,8               | 513,0         | 276,5                     | 123,0        | 56,5          | 67,8         | 180,0          |
| 36-60        | 7,6                 | 6,3           | 0,0                       | 0,0          | 6,3           | 7,6          | 0,0            |
| 61-90        | 7,6                 | 67,6          | 0,0                       | 0,0          | 67,6          | 7,6          | 0,0            |
| 91-180       | 108,9               | 84,2          | 30,0                      | 0,0          | 14,2          | 68,9         | 40,0           |
| >180         | 115,3               | 124,7         | 64,9                      | 21,0         | 19,8          | 54,3         | 40,0           |
| <b>Total</b> | <b>1137,5</b>       | <b>1131,7</b> | <b>521,2</b>              | <b>409,8</b> | <b>184,5</b>  | <b>301,7</b> | <b>426,0</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         | 2,4 %              | 2,8 %                        | 2,2 %        | 2,4 %        |
| 15-35        | 2,4 %              | 3,3 %                        | 1,6 %        | 2,5 %        |
| 36-60        | -                  | 3,5 %                        | 2,5 %        | 3,0 %        |
| 61-90        | -                  | 3,6 %                        | 3,1 %        | 3,5 %        |
| 91-180       | 2,5 %              | 2,6 %                        | 3,1 %        | 2,8 %        |
| >180         | 3,3 %              | 3,4 %                        | 3,1 %        | 3,3 %        |
| <b>Total</b> | <b>2,5 %</b>       | <b>3,2 %</b>                 | <b>2,2 %</b> | <b>2,6 %</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**

| Sector                           | 10 al 14 de marzo |            |             |             | 17 al 21 de marzo |            |             |             | 24 al 28 de marzo |           |             |             |
|----------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|
|                                  | Delivery          |            | NDF         |             | Delivery          |            | NDF         |             | Delivery          |           | NDF         |             |
|                                  | C                 | V          | C           | V           | C                 | V          | C           | V           | C                 | V         | C           | V           |
| <b>Sector Financiero**</b>       | 32                | 222        | 3814        | 3523        | 20                | 98         | 4581        | 5242        | 12                | 82        | 1836        | 2138        |
| <b>Intragrupa y off-shore***</b> | 0                 | 0          | 1838        | 1120        | 4                 | 0          | 3658        | 2124        | 0                 | 0         | 1056        | 247         |
| <b>Otros</b>                     | 222               | 32         | 580         | 1590        | 94                | 20         | 380         | 1252        | 82                | 12        | 582         | 1089        |
| <b>Total</b>                     | <b>253</b>        | <b>253</b> | <b>6233</b> | <b>6233</b> | <b>118</b>        | <b>118</b> | <b>8618</b> | <b>8618</b> | <b>94</b>         | <b>94</b> | <b>3474</b> | <b>3474</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.

1

<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.