

**Fecha de Publicación: 18 de marzo de 2014**

**Fecha de Información: 14 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\$1076,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.<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	239,3	89,1	75,0	210,5	14,1	28,8	0,0
15-35	412,6	324,8	211,0	129,0	9,8	179,6	104,0
36-60	39,9	43,4	1,6	0,0	11,8	9,9	30,0
61-90	6,1	12,4	0,0	0,0	12,4	6,1	0,0
91-180	4,3	20,2	0,0	0,0	20,2	4,3	0,0
>180	5,4	17,8	0,0	0,0	12,8	0,4	5,0
<b>Total</b>	<b>707,6</b>	<b>507,8</b>	<b>287,6</b>	<b>339,5</b>	<b>81,2</b>	<b>229,1</b>	<b>139,0</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	-	3,1 %	2,9 %	2,9 %
15-35	3,0 %	3,4 %	2,9 %	3,1 %
36-60	2,9 %	3,5 %	2,7 %	3,0 %
61-90	-	3,6 %	2,9 %	3,4 %
91-180	-	3,5 %	2,9 %	3,4 %
>180	3,1 %	3,5 %	2,7 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,1 %</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	221	3814	3524	20	95	4807	5277	12	83	1849	2194
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1838	1120	4	0	3688	2330	0	0	1101	252
<b>Otros</b>	221	32	581	1589	91	20	384	1273	83	12	592	1098
<b>Total</b>	<b>252</b>	<b>252</b>	<b>6233</b>	<b>6233</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>8880</b>	<b>8880</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>3543</b>	<b>3543</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.