

**Fecha de Publicación: 20 de marzo de 2014**

**Fecha de Información: 18 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\$1277,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	313,2	179,8	111,5	202,0	28,3	71,2	40,0
15-35	409,2	208,9	171,0	258,8	7,9	120,4	30,0
36-60	11,7	95,3	49,1	10,0	46,2	1,7	0,0
61-90	3,2	26,2	0,0	2,0	26,2	1,2	0,0
91-180	17,5	38,5	0,2	0,0	23,3	2,5	15,0
>180	20,1	48,6	30,0	8,5	8,6	1,6	10,0
<b>Total</b>	<b>774,9</b>	<b>597,1</b>	<b>361,8</b>	<b>481,3</b>	<b>140,3</b>	<b>198,6</b>	<b>95,0</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	0,3 %	2,7 %	2,7 %	2,5 %
15-35	2,6 %	2,5 %	2,5 %	2,5 %
36-60	-	2,8 %	2,8 %	2,8 %
61-90	-	3,2 %	2,4 %	3,1 %
91-180	2,9 %	3,1 %	0,5 %	2,9 %
>180	3,0 %	3,2 %	2,8 %	3,1 %
<b>Total</b>	<b>1,7 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>2,6 %</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**

Sectores	17 al 21 de marzo				24 al 28 de marzo				31 de mar. al 4 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	85	5117	5510	12	93	1982	2275	17	50	2212	2296
Intragrupo y off-shore***	4	0	3809	2531	0	0	1146	290	0	0	1320	918
Otros	81	20	409	1295	93	12	609	1172	50	17	379	697
<b>Total</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>9335</b>	<b>9335</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>3737</b>	<b>3737</b>	<b>67</b>	<b>67</b>	<b>3911</b>	<b>3911</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>

<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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.