

**Fecha de Publicación: 22 de marzo de 2014**

**Fecha de Información: 20 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\$2554,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	549,8	157,4	92,0	455,9	45,3	73,8	20,1
15-35	628,8	855,6	466,4	279,5	173,9	134,0	215,3
36-60	83,0	123,0	13,3	0,0	69,7	43,0	40,0
61-90	146,6	115,6	11,6	10,0	88,9	121,6	15,0
91-180	57,3	114,3	0,2	20,0	79,1	2,3	35,0
>180	14,1	39,9	10,1	7,4	23,8	0,7	6,0
<b>Total</b>	<b>1479,6</b>	<b>1405,7</b>	<b>593,7</b>	<b>772,8</b>	<b>480,7</b>	<b>375,5</b>	<b>331,4</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,4 %	0,7 %	0,2 %	0,3 %
15-35	0,0 %	0,4 %	-0,4 %	0,1 %
36-60	0,2 %	1,8 %	0,2 %	1,0 %
61-90	1,0 %	2,0 %	0,4 %	1,0 %
91-180	1,8 %	2,5 %	1,8 %	2,2 %
>180	2,9 %	3,0 %	2,5 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>0,3 %</b>	<b>1,0 %</b>	<b>0,1 %</b>	<b>0,5 %</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	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	83	5785	5571	13	103	2247	2437	17	59	2523	2704
Intragruppo y off-shore***	4	0	3872	3197	0	0	1211	479	0	0	1577	1008
Otros	79	20	407	1297	103	13	702	1243	59	17	490	879
<b>Total</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>10065</b>	<b>10065</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>4159</b>	<b>4159</b>	<b>77</b>	<b>77</b>	<b>4591</b>	<b>4591</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 intragruppo.