

**Fecha de Publicación: 31 de marzo de 2014**

**Fecha de Información: 27 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\$1140,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	290,4	252,8	117,3	75,0	20,9	100,7	114,7
15-35	224,1	339,2	157,5	93,5	97,7	46,6	84,0
36-60	13,6	11,6	0,0	0,0	11,6	13,6	0,0
61-90	34,5	70,5	0,0	0,0	70,3	34,2	0,3
91-180	4,9	31,4	0,0	3,6	31,4	1,3	0,0
>180	11,8	64,7	30,2	0,0	24,5	1,8	10,0
<b>Total</b>	<b>579,2</b>	<b>770,3</b>	<b>305,0</b>	<b>172,1</b>	<b>256,3</b>	<b>198,2</b>	<b>209,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,4 %	3,6 %	2,9 %	3,8 %
15-35	3,1 %	3,3 %	2,7 %	3,1 %
36-60	-	3,5 %	2,8 %	3,1 %
61-90	3,1 %	3,5 %	2,9 %	3,3 %
91-180	-	3,4 %	3,0 %	3,3 %
>180	3,3 %	3,5 %	2,3 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>4,4 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>3,4 %</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	24 al 28 de marzo				31 de mar. al 4 de abril				7 al 11 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	100	2524	2827	19	71	3558	3237	32	134	2575	2311
Intragruppo y off-shore***	0	0	1465	613	0	0	1820	1473	0	0	1338	895
Otros	100	14	730	1279	71	19	542	1211	134	32	345	1053
<b>Total</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>4718</b>	<b>4718</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>5920</b>	<b>5920</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>4258</b>	<b>4258</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.