

**Fecha de Publicación: 4 de abril de 2014**

**Fecha de Información: 02 de abril 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\$1211,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.<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	161,4	178,1	145,0	107,0	10,1	31,4	23,0
15-35	430,7	315,0	204,9	179,5	11,1	152,2	99,0
36-60	48,4	20,2	2,6	20,0	17,4	28,2	0,2
61-90	69,4	9,7	0,0	0,0	9,7	69,4	0,0
91-180	43,9	39,0	0,0	9,0	24,0	19,9	15,0
>180	21,8	21,4	0,0	10,0	11,4	1,8	10,0
<b>Total</b>	<b>775,6</b>	<b>583,3</b>	<b>352,5</b>	<b>325,5</b>	<b>83,6</b>	<b>302,9</b>	<b>147,2</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	1,0 %	2,3 %	1,5 %	1,9 %
15-35	2,8 %	2,9 %	2,5 %	2,7 %
36-60	2,9 %	3,2 %	2,6 %	2,8 %
61-90	-	5,3 %	2,4 %	2,8 %
91-180	2,9 %	3,4 %	2,8 %	3,0 %
>180	3,0 %	3,6 %	2,8 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>2,5 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>2,3 %</b>	<b>2,5 %</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	31 de mar. al 4 de abril				7 al 11 de abril				14 al 18 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	76	66	3981	3800	36	137	2908	2591	8	91	2447	2794
Intragrupo y off-shore***	0	0	2163	1678	0	1	1417	933	0	0	1689	1496
Otros	66	76	567	1233	137	35	373	1174	91	8	537	382
<b>Total</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>6710</b>	<b>6710</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>4697</b>	<b>4697</b>	<b>99</b>	<b>99</b>	<b>4672</b>	<b>4672</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 intragrupo.