

**Fecha de Publicación: 8 de abril de 2014**

**Fecha de Información: 04 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\$1022,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.<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	156,9	187,5	116,0	23,0	3,5	65,9	68,0
15-35	415,6	275,0	144,8	255,8	21,8	51,4	108,5
36-60	8,6	34,2	0,0	0,0	34,2	8,6	0,0
61-90	0,7	44,6	10,0	0,4	34,6	0,3	0,0
91-180	0,1	43,4	0,0	0,0	43,4	0,1	0,0
>180	1,9	30,7	10,7	0,8	20,0	1,1	0,0
<b>Total</b>	<b>583,8</b>	<b>615,5</b>	<b>281,5</b>	<b>280,0</b>	<b>157,5</b>	<b>127,3</b>	<b>176,5</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	2,9 %	2,5 %	2,0 %	2,4 %
15-35	2,9 %	3,1 %	2,7 %	2,8 %
36-60	-	3,4 %	2,7 %	3,3 %
61-90	-	3,7 %	3,0 %	3,7 %
91-180	-	3,4 %	3,0 %	3,4 %
>180	-	3,0 %	3,1 %	3,1 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,5 %</b>	<b>2,8 %</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	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**	75	68	3990	3797	37	136	3079	2805	8	91	2530	2878
Intragrupa y off-shore***	0	0	2163	1687	0	1	1528	984	0	0	1759	1508
Otros	68	75	564	1233	136	36	374	1192	91	8	538	441
<b>Total</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>6716</b>	<b>6716</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>4981</b>	<b>4981</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>4827</b>	<b>4827</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.