

**Fecha de Publicación: 10 de abril de 2014**

**Fecha de Información: 08 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\$1020,6 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	93,7	152,3	95,0	36,5	32,3	32,2	25,0
15-35	314,1	261,6	143,8	182,5	55,9	69,6	62,0
36-60	65,1	47,4	0,0	0,0	37,4	55,1	10,0
61-90	101,6	6,1	0,0	0,0	6,1	101,6	0,0
91-180	22,9	14,4	0,0	1,2	14,4	21,7	0,0
>180	22,0	26,5	10,6	0,0	6,0	12,0	10,0
<b>Total</b>	<b>619,4</b>	<b>508,3</b>	<b>249,3</b>	<b>220,2</b>	<b>151,9</b>	<b>292,2</b>	<b>107,0</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	2,7 %	2,8 %	2,9 %	2,8 %
15-35	2,8 %	3,1 %	2,4 %	2,8 %
36-60	2,8 %	3,3 %	2,5 %	2,8 %
61-90	-	3,6 %	2,2 %	2,3 %
91-180	-	4,0 %	3,0 %	3,4 %
>180	3,5 %	3,6 %	3,2 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>2,8 %</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**

Sector	7 al 11 de abril						14 al 18 de abril				21 al 25 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V		
Sector Financiero**	43	138	3301	2972	8	95	2591	3046	17	204	3220	3273		
Intragrupa y off-shore***	0	1	1639	1131	0	0	1912	1508	0	0	1806	1174		
Otros	138	42	410	1247	95	8	539	487	204	17	524	1103		
<b>Total</b>	<b>181</b>	<b>181</b>	<b>5350</b>	<b>5350</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>5042</b>	<b>5042</b>	<b>221</b>	<b>221</b>	<b>5550</b>	<b>5550</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.