

**Fecha de Publicación: 15 de abril de 2014**

**Fecha de Información: 11 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\$1098,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.<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	142,2	183,8	51,0	32,0	59,8	37,2	73,0
15-35	507,8	357,8	129,8	130,5	34,1	183,3	194,0
36-60	21,7	35,3	0,0	0,0	35,3	21,7	0,0
61-90	6,3	8,2	0,0	0,0	8,2	6,3	0,0
91-180	20,8	18,2	0,0	1,8	18,2	19,0	0,0
>180	40,3	52,9	20,0	0,0	2,9	10,3	30,0
<b>Total</b>	<b>739,0</b>	<b>656,3</b>	<b>200,8</b>	<b>164,3</b>	<b>158,6</b>	<b>277,7</b>	<b>297,0</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	3,4 %	3,5 %	2,3 %	3,2 %
15-35	3,5 %	3,4 %	2,8 %	3,1 %
36-60	-	3,5 %	2,7 %	3,2 %
61-90	-	4,2 %	2,8 %	3,6 %
91-180	-	4,0 %	2,9 %	3,4 %
>180	3,5 %	3,9 %	3,3 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>3,2 %</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**	42	138	3522	3040	10	157	2768	3220	23	220	3514	3799
Intragruppo y off-shore***	0	1	1652	1298	0	0	2034	1549	0	0	2092	1212
Otros	138	41	434	1270	156	10	466	500	220	23	591	1186
<b>Total</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>5608</b>	<b>5608</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>5268</b>	<b>5268</b>	<b>243</b>	<b>243</b>	<b>6197</b>	<b>6197</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.