

**Fecha de Publicación: 23 de abril de 2014**

**Fecha de Información: 21 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\$674,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.<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	52,0	61,3	50,0	17,0	11,3	35,0	0,0
15-35	218,6	191,8	112,0	52,0	21,8	108,6	58,0
36-60	77,5	18,9	0,0	0,0	8,9	67,5	10,0
61-90	13,7	6,1	0,0	2,4	4,8	10,0	1,3
91-180	46,8	69,6	0,0	0,0	49,6	26,8	20,0
>180	6,1	1,5	0,0	0,0	1,5	6,1	0,0
<b>Total</b>	<b>414,6</b>	<b>349,2</b>	<b>162,0</b>	<b>71,4</b>	<b>97,9</b>	<b>254,0</b>	<b>89,3</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	-	4,0 %	2,0 %	3,0 %
15-35	3,4 %	2,8 %	2,8 %	2,9 %
36-60	3,4 %	3,9 %	3,2 %	3,3 %
61-90	3,7 %	4,4 %	3,3 %	3,6 %
91-180	3,6 %	4,0 %	3,3 %	3,7 %
>180	-	4,3 %	3,4 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,1 %</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	21 al 25 de abril				28 de abr. al 2 de mayo				5 al 9 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	224	3881	4205	11	80	2442	3355	5	72	2408	1990
Intragruppo y off-shore***	0	0	2350	1381	0	0	1655	837	0	0	961	941
Otros	224	26	602	1246	80	11	571	475	72	5	337	774
<b>Total</b>	<b>249</b>	<b>249</b>	<b>6832</b>	<b>6832</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>4668</b>	<b>4668</b>	<b>77</b>	<b>77</b>	<b>3706</b>	<b>3706</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.