

**Fecha de Publicación: 24 de abril de 2014**

**Fecha de Información: 22 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\$1753,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	340,9	407,3	178,8	59,0	80,5	133,9	148,0
15-35	485,2	362,6	210,6	221,0	19,0	131,2	133,0
36-60	31,1	8,0	4,7	0,0	3,3	31,1	0,0
61-90	35,7	20,3	0,0	0,0	20,3	35,7	0,0
91-180	134,7	180,4	85,0	18,5	15,4	36,2	80,0
>180	46,5	62,3	60,0	0,0	2,3	46,5	0,0
<b>Total</b>	<b>1074,1</b>	<b>1040,8</b>	<b>539,0</b>	<b>298,5</b>	<b>140,8</b>	<b>414,6</b>	<b>361,0</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	4,1 %	3,3 %	3,0 %	3,4 %
15-35	3,6 %	3,8 %	3,0 %	3,3 %
36-60	-	3,9 %	3,2 %	3,4 %
61-90	-	3,8 %	3,3 %	3,5 %
91-180	3,6 %	3,3 %	3,3 %	3,4 %
>180	-	4,0 %	3,5 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,4 %</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**	28	224	3999	4365	14	80	2615	3592	6	73	2454	2008
Intragrupo y off-shore***	0	0	2408	1436	0	0	1775	841	0	0	964	941
Otros	224	28	672	1279	80	14	579	537	73	6	342	810
<b>Total</b>	<b>252</b>	<b>252</b>	<b>7080</b>	<b>7080</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>4970</b>	<b>4970</b>	<b>80</b>	<b>80</b>	<b>3759</b>	<b>3759</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.