

**Fecha de Publicación: 25 de abril de 2014**

**Fecha de Información: 23 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\$1564,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	232,7	101,4	71,2	194,5	10,2	18,2	20,0
15-35	557,5	532,9	358,6	140,0	3,4	246,5	171,0
36-60	28,5	43,6	30,0	0,0	3,6	18,5	10,0
61-90	42,4	6,4	0,0	0,0	6,4	42,4	0,0
91-180	59,5	61,4	0,0	0,0	16,4	14,5	45,0
>180	61,8	142,9	75,0	0,0	6,9	0,8	61,0
<b>Total</b>	<b>982,4</b>	<b>888,6</b>	<b>534,7</b>	<b>334,5</b>	<b>46,9</b>	<b>340,9</b>	<b>307,0</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	3,0 %	4,0 %	3,0 %	3,3 %
15-35	3,0 %	3,4 %	3,0 %	3,1 %
36-60	3,1 %	3,4 %	3,0 %	3,2 %
61-90	-	9,6 %	3,1 %	4,0 %
91-180	3,5 %	3,9 %	3,3 %	3,5 %
>180	3,8 %	3,5 %	3,5 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,3 %</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	231	4108	4368	14	79	2656	3607	6	74	2537	2079
Intragrupo y off-shore***	0	0	2416	1544	0	0	1788	881	0	0	1014	988
Otros	231	28	668	1280	79	14	583	538	74	6	343	827
<b>Total</b>	<b>259</b>	<b>259</b>	<b>7191</b>	<b>7191</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>5027</b>	<b>5027</b>	<b>80</b>	<b>80</b>	<b>3894</b>	<b>3894</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.