

**Fecha de Publicación: 28 de abril de 2014**

**Fecha de Información: 24 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\$1161,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.<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	91,4	61,5	35,0	37,5	6,5	33,9	20,0
15-35	267,4	413,3	337,0	154,0	32,3	69,4	44,0
36-60	13,3	3,2	0,0	0,0	3,2	13,3	0,0
61-90	116,8	45,1	44,5	0,0	0,6	116,8	0,0
91-180	18,3	41,3	32,2	0,0	9,1	18,3	0,0
>180	100,1	53,7	45,1	0,0	8,6	100,1	0,0
<b>Total</b>	<b>607,3</b>	<b>618,1</b>	<b>493,8</b>	<b>191,5</b>	<b>60,3</b>	<b>351,8</b>	<b>64,0</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	3,6 %	4,5 %	1,7 %	2,9 %
15-35	3,1 %	2,9 %	2,7 %	2,8 %
36-60	-	3,5 %	2,7 %	2,8 %
61-90	-	3,3 %	2,9 %	3,0 %
91-180	-	3,5 %	3,1 %	3,4 %
>180	-	3,4 %	3,3 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>3,0 %</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	232	4135	4368	14	80	2712	3633	6	75	2566	2145
Intragruppo y off-shore***	0	0	2416	1575	0	0	1790	886	0	0	1058	990
Otros	232	28	668	1276	80	14	587	569	75	6	345	833
<b>Total</b>	<b>261</b>	<b>261</b>	<b>7219</b>	<b>7219</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>5088</b>	<b>5088</b>	<b>81</b>	<b>81</b>	<b>3969</b>	<b>3969</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.