

**Fecha de Publicación: 2 de mayo de 2014**

**Fecha de Información: 29 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\$1608,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	384,1	145,0	55,1	288,7	12,0	17,4	78,0
15-35	492,8	581,7	295,6	231,2	55,1	30,6	231,0
36-60	69,5	27,0	22,2	20,0	4,8	49,5	0,0
61-90	13,7	11,4	2,0	1,7	9,0	11,5	0,4
91-180	116,7	45,2	0,0	0,0	25,2	96,7	20,0
>180	34,7	16,3	0,0	0,0	16,3	34,7	0,0
<b>Total</b>	<b>1111,5</b>	<b>826,6</b>	<b>374,8</b>	<b>541,6</b>	<b>122,4</b>	<b>240,4</b>	<b>329,4</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	2,2 %	3,7 %	2,1 %	2,4 %
15-35	3,1 %	3,3 %	2,9 %	3,1 %
36-60	-	3,7 %	3,1 %	3,3 %
61-90	3,5 %	4,1 %	3,2 %	3,6 %
91-180	3,5 %	3,9 %	3,4 %	3,5 %
>180	-	4,0 %	3,6 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>2,8 %</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	28 de abr. al 2 de mayo				5 al 9 de mayo				12 al 16 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	72	3428	3951	8	75	2801	2538	21	135	2147	2313
Intragrupa y off-shore***	0	0	1953	1384	0	0	1306	1053	0	0	1047	399
Otros	72	18	607	654	75	8	359	875	134	21	585	1067
<b>Total</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>5989</b>	<b>5989</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>4467</b>	<b>4467</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>3779</b>	<b>3779</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.