

**Fecha de Publicación: 9 de mayo de 2014**

**Fecha de Información: 07 de mayo 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\$1450,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.<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	294,7	163,1	97,0	182,6	18,1	64,1	48,0
15-35	417,9	400,7	200,0	117,8	25,7	125,1	175,0
36-60	26,7	37,7	0,8	0,9	20,7	9,6	16,2
61-90	144,4	32,3	0,0	13,6	13,7	112,2	18,6
91-180	36,2	35,6	0,9	0,0	34,7	36,2	0,0
>180	56,2	72,8	25,0	0,0	37,8	46,2	10,0
<b>Total</b>	<b>976,0</b>	<b>742,3</b>	<b>323,7</b>	<b>314,9</b>	<b>150,7</b>	<b>393,3</b>	<b>267,8</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	3,2 %	3,9 %	3,2 %	3,4 %
15-35	3,2 %	3,8 %	3,3 %	3,4 %
36-60	3,6 %	3,8 %	3,2 %	3,6 %
61-90	3,6 %	4,1 %	3,4 %	3,5 %
91-180	-	3,9 %	3,5 %	3,7 %
>180	3,8 %	4,0 %	3,7 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,5 %</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	5 al 9 de mayo				12 al 16 de mayo				19 al 23 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	74	3308	3128	43	146	2497	2824	17	119	2930	3309
Intragruppo y off-shore***	0	1	1678	1323	0	0	1373	575	5	0	1987	1030
Otros	74	28	397	933	145	43	672	1143	114	17	473	1051
<b>Total</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>5383</b>	<b>5383</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>4542</b>	<b>4542</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>5390</b>	<b>5390</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.