

Fecha de Publicación: 10 de enero de 2014

Fecha de Información: 08 de enero 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\$1061,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.<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	275,4	117,0	49,5	185,5	10,5	32,9	57,0
15-35	222,3	323,5	276,3	32,5	45,6	188,1	1,7
36-60	72,8	109,7	0,0	0,0	69,1	32,3	40,6
61-90	6,1	5,9	0,0	0,0	0,9	1,1	5,0
91-180	7,3	5,8	0,0	0,0	0,8	2,3	5,0
>180	2,2	23,0	0,0	0,0	23,0	2,2	0,0
<b>Total</b>	<b>586,1</b>	<b>584,8</b>	<b>325,8</b>	<b>218,0</b>	<b>149,9</b>	<b>258,9</b>	<b>109,2</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	1,8 %	2,8 %	1,7 %	1,9 %
15-35	3,1 %	3,1 %	2,8 %	3,0 %
36-60	2,8 %	3,4 %	2,7 %	3,1 %
61-90	3,1 %	3,0 %	2,7 %	3,1 %
91-180	3,3 %	3,7 %	2,8 %	3,2 %
>180	-	3,3 %	2,9 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>2,3 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,3 %</b>	<b>2,7 %</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**

Sectores	6 al 10 de enero				13 al 17 de enero				20 al 24 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	54	63	3611	4084	52	139	3163	3116	5	169	1910	2273
Intragrupa y off-shore***	0	0	2430	1574	0	1	1813	1019	0	0	1104	247
Otros	63	54	511	893	139	51	442	1282	169	5	445	939
<b>Total</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>6551</b>	<b>6551</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>5417</b>	<b>5417</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>3459</b>	<b>3459</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.