

Fecha de Publicación: 16 de enero de 2014

Fecha de Información: 14 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\$1317,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.<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	249,8	140,5	75,4	94,0	2,1	92,8	63,0
15-35	623,3	342,9	109,0	292,4	19,8	116,8	214,1
36-60	23,2	138,6	20,0	0,0	103,6	8,2	15,0
61-90	22,1	15,9	0,0	0,0	15,9	22,1	0,0
91-180	17,7	2,7	0,0	0,0	2,7	17,7	0,0
>180	21,8	31,0	0,0	0,0	11,0	1,8	20,0
<b>Total</b>	<b>958,0</b>	<b>671,6</b>	<b>204,4</b>	<b>386,4</b>	<b>155,1</b>	<b>259,5</b>	<b>312,1</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 %	2,6 %	2,8 %	1,8 %
15-35	2,6 %	3,2 %	2,8 %	2,8 %
36-60	3,2 %	3,4 %	2,8 %	3,3 %
61-90	-	3,5 %	3,1 %	3,3 %
91-180	-	4,0 %	3,1 %	3,2 %
>180	1,6 %	3,5 %	2,8 %	2,3 %
<b>Total</b>	<b>1,7 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>2,6 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	13 al 17 de enero				20 al 24 de enero				27 al 31 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	57	147	3673	3486	10	168	2132	2477	9	62	1956	2313
Intragruppo y off-shore***	0	1	2027	1368	0	0	1176	320	0	0	1209	426
Otros	147	56	456	1303	168	10	506	1017	62	9	452	878
<b>Total</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>6156</b>	<b>6156</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>3813</b>	<b>3813</b>	<b>71</b>	<b>71</b>	<b>3617</b>	<b>3617</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.