

Fecha de Publicación: 22 de enero de 2014

Fecha de Información: 20 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\$284,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	53,5	7,5	0,0	42,3	7,5	11,3	0,0
15-35	60,8	86,7	64,3	17,5	2,4	23,3	20,0
36-60	10,3	20,1	17,5	0,0	2,6	10,3	0,0
61-90	10,0	2,5	0,0	0,1	2,5	9,9	0,0
91-180	3,3	9,7	0,0	0,0	9,7	3,3	0,0
>180	23,0	37,0	0,0	0,0	17,0	3,0	20,0
<b>Total</b>	<b>160,9</b>	<b>163,5</b>	<b>81,8</b>	<b>59,9</b>	<b>41,7</b>	<b>61,0</b>	<b>40,0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	4,1 %	2,6 %	2,8 %
15-35	3,6 %	3,9 %	3,1 %	3,6 %
36-60	-	3,6 %	2,9 %	3,4 %
61-90	-	4,5 %	3,2 %	3,4 %
91-180	-	2,5 %	2,7 %	2,6 %
>180	4,8 %	3,7 %	3,1 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</b>	<b>3,7 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,4 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	20 al 24 de enero				27 al 31 de enero				3 al 7 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	18	102	2715	2928	11	62	2143	2403	7	84	1711	1793
<b>Intragrupoy off-shore***</b>	0	0	1338	441	0	0	1223	446	0	0	973	286
<b>Otros</b>	102	18	584	1269	62	11	476	993	84	7	232	837
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>4638</b>	<b>4638</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>3842</b>	<b>3842</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>2916</b>	<b>2916</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.