

Fecha de Publicación: 30 de enero de 2014

Fecha de Información: 28 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\$1471,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.<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	643,1	491,6	81,8	206,0	8,9	36,1	401,0
15-35	348,6	294,8	188,0	104,0	26,8	164,6	80,0
36-60	28,7	16,6	0,0	0,0	11,6	23,7	5,0
61-90	11,8	1,8	0,0	0,0	1,8	11,8	0,0
91-180	53,7	46,1	0,0	0,0	16,1	23,7	30,0
>180	31,2	49,7	15,0	0,0	4,7	1,2	30,0
<b>Total</b>	<b>1117,0</b>	<b>900,6</b>	<b>284,8</b>	<b>310,0</b>	<b>69,9</b>	<b>261,0</b>	<b>546,0</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	1,5 %	3,4 %	4,9 %	2,9 %
15-35	1,4 %	2,8 %	3,1 %	2,7 %
36-60	3,3 %	3,5 %	2,5 %	2,9 %
61-90	-	3,4 %	2,8 %	2,9 %
91-180	0,0 %	3,7 %	3,0 %	1,9 %
>180	3,4 %	3,4 %	2,9 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>1,5 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>2,8 %</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	27 al 31 de enero				3 al 7 de febrero				10 al 14 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	65	3454	3014	7	89	2452	2444	25	103	3188	2810
Intragrupa y off-shore***	0	0	1332	853	0	0	1086	346	0	0	1580	1102
Otros	65	13	524	1443	89	7	390	1138	103	25	487	1343
<b>Total</b>	<b>78</b>	<b>78</b>	<b>5311</b>	<b>5311</b>	<b>96</b>	<b>96</b>	<b>3928</b>	<b>3928</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>5255</b>	<b>5255</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.