

Fecha de Publicación: 31 de enero de 2014

Fecha de Información: 29 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\$2086,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.<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	750,3	171,8	12,5	338,0	24,8	277,8	134,5
15-35	477,9	726,9	442,5	132,0	63,9	125,4	220,5
36-60	117,5	88,6	40,0	0,0	33,6	102,5	15,0
61-90	23,4	19,5	0,7	0,0	3,8	8,4	15,0
91-180	25,2	11,9	0,0	0,0	11,9	25,2	0,0
>180	22,6	39,1	31,1	0,0	5,0	19,6	3,0
<b>Total</b>	<b>1416,9</b>	<b>1057,8</b>	<b>526,8</b>	<b>470,0</b>	<b>143,0</b>	<b>558,9</b>	<b>388,0</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	1,9 %	4,8 %	3,1 %	3,0 %
15-35	2,7 %	3,4 %	2,8 %	3,1 %
36-60	3,2 %	3,4 %	3,0 %	3,2 %
61-90	3,4 %	4,0 %	2,9 %	3,4 %
91-180	-	3,8 %	4,9 %	4,5 %
>180	3,2 %	3,3 %	3,0 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>2,5 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,1 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

<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.

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	69	3675	3194	9	77	2717	2528	25	104	3422	2994
Intragrupa y off-shore***	0	0	1428	1022	0	0	1091	419	0	0	1681	1077
Otros	69	13	563	1450	77	9	409	1268	104	25	507	1538
<b>Total</b>	<b>82</b>	<b>82</b>	<b>5666</b>	<b>5666</b>	<b>87</b>	<b>87</b>	<b>4216</b>	<b>4216</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>5610</b>	<b>5610</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.