

Fecha de Publicación: 4 de febrero de 2014

Fecha de Información: 31 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\$1081,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.<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	172,8	147,1	69,0	69,5	8,1	33,3	70,0
15-35	370,6	395,5	93,5	169,0	129,0	28,6	173,0
36-60	13,0	13,9	0,0	0,0	13,9	13,0	0,0
61-90	31,4	38,1	0,0	0,5	13,1	5,9	25,0
91-180	12,0	12,5	0,0	0,2	12,5	11,8	0,0
>180	78,0	84,2	46,0	11,0	18,2	47,0	20,0
<b>Total</b>	<b>677,8</b>	<b>691,3</b>	<b>208,5</b>	<b>250,2</b>	<b>194,8</b>	<b>139,6</b>	<b>288,0</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	1,4 %	4,1 %	0,6 %	1,8 %
15-35	2,2 %	3,3 %	2,7 %	2,7 %
36-60	-	2,0 %	3,4 %	2,7 %
61-90	0,6 %	3,5 %	2,6 %	1,7 %
91-180	-	3,5 %	2,8 %	3,2 %
>180	3,3 %	2,6 %	2,9 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>1,9 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>2,2 %</b>	<b>2,5 %</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**	12	63	3719	3236	12	79	2876	2732	28	103	3654	3098
Intragrupa y off-shore***	0	0	1434	1035	0	1	1195	473	0	0	1736	1155
Otros	63	12	569	1450	79	11	434	1299	103	28	528	1665
<b>Total</b>	<b>75</b>	<b>75</b>	<b>5721</b>	<b>5721</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>4505</b>	<b>4505</b>	<b>131</b>	<b>131</b>	<b>5918</b>	<b>5918</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.