

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$767.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	114.9	281.5	182.0	12.9	15.4	17.9	84.1
15-35	202.2	177.9	83.7	114.0	48.3	42.3	45.9
36-60	7.0	27.5	0.0	0.0	27.5	7.0	0.0
61-90	23.2	3.3	0.0	0.0	3.3	23.2	0.0
91-180	4.9	23.1	0.0	0.0	23.1	4.9	0.0
>180	7.3	24.4	14.3	0.0	10.1	7.3	0.0
Total	359.4	537.7	280.0	126.9	127.8	102.6	130.0

* 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 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
15-35	1.8 %	2.0 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	2.7 %	1.3 %	2.4 %
61-90	-	1.9 %	1.4 %	1.5 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.7 %
>180	-	1.8 %	1.3 %	1.6 %
Total	1.8 %	2.1 %	1.6 %	1.8 %

*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

Sector	24 al 28 de diciembre				31 de dic. al 4 de enero				7 al 11 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	142	2478	2647	10	44	1873	2215	8	86	2695	3655
Intragruppo y off-shore***	0	0	1284	1210	0	0	1259	901	0	0	2294	1063
Otros	142	24	470	375	44	10	157	173	86	8	296	568
Total	166	166	4232	4232	54	54	3289	3289	94	94	5285	5285

* 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.

¹ Datos provisionales.

² 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.