

**Fecha de Publicación: 9 de enero de 2014**

**Fecha de Información: 07 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\$826,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	161,5	98,9	39,5	106,7	18,4	13,8	41,0
15-35	180,2	288,4	165,3	40,2	88,1	105,0	35,0
36-60	10,6	19,7	0,0	0,0	9,7	0,6	10,0
61-90	58,9	16,7	5,0	20,0	6,7	33,9	5,0
91-180	0,8	21,2	0,0	0,0	21,2	0,8	0,0
>180	13,5	56,7	0,8	0,0	45,9	3,5	10,0
<b>Total</b>	<b>425,4</b>	<b>501,5</b>	<b>210,6</b>	<b>166,9</b>	<b>190,0</b>	<b>157,5</b>	<b>101,0</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	
3-14	6,0 %	3,1 %	2,1 %	3,1 %
15-35	2,8 %	2,7 %	2,1 %	2,5 %
36-60	3,1 %	3,4 %	0,9 %	3,2 %
61-90	3,3 %	4,0 %	2,8 %	3,0 %
91-180	-	3,4 %	-0,1 %	3,3 %
>180	3,2 %	3,1 %	1,7 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>2,2 %</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	6 al 10 de enero				13 al 17 de enero				20 al 24 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	54	65	3441	4058	40	138	3092	3021	5	169	1885	2233
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2409	1410	0	1	1784	1019	0	0	1064	226
<b>Otros</b>	65	54	506	888	138	39	432	1268	169	5	445	936
<b>Total</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>6356</b>	<b>6356</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>5308</b>	<b>5308</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>3395</b>	<b>3395</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.