

Fecha de Publicación: 13 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 08 de noviembre de 2013 <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\$1121,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	379,2	402,7	118,0	101,0	64,5	58,0	220,3
15-35	212,7	345,3	237,5	64,9	4,8	44,8	103,0
36-60	27,7	23,1	0,0	0,0	2,4	7,0	20,7
61-90	4,5	12,2	0,0	0,0	12,2	4,5	0,0
91-180	12,2	3,2	0,0	0,0	3,2	12,2	0,0
>180	18,4	28,6	20,0	0,0	4,1	14,0	4,5
<b>Total</b>	<b>654,8</b>	<b>815,1</b>	<b>375,5</b>	<b>165,9</b>	<b>91,2</b>	<b>140,5</b>	<b>348,4</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	6,4 %	2,2 %	1,5 %	3,7 %
15-35	3,5 %	2,6 %	3,1 %	2,9 %
36-60	3,2 %	4,0 %	1,4 %	2,8 %
61-90	-	3,5 %	1,4 %	2,9 %
91-180	-	2,5 %	3,0 %	2,9 %
>180	3,0 %	3,2 %	2,8 %	3,1 %
<b>Total</b>	<b>5,3 %</b>	<b>2,5 %</b>	<b>2,2 %</b>	<b>3,3 %</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	4 al 8 de noviembre				11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	17	78	4833	4146	19	121	3174	2565	35	84	2680	2786
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	1	2013	1410	0	0	1201	933	0	0	1186	621
<b>Otros</b>	78	15	582	1872	121	19	496	1373	84	35	528	988
<b>Total</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>7428</b>	<b>7428</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>4871</b>	<b>4871</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>4394</b>	<b>4394</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.