

Fecha de Publicación: 14 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 12 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\$1586,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.<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	326,1	319,7	155,9	53,9	67,8	176,3	96,0
15-35	440,1	315,6	173,8	198,3	6,8	106,8	135,0
36-60	80,0	108,5	20,0	0,0	78,5	70,0	10,0
61-90	21,8	42,4	0,0	0,0	42,4	21,8	0,0
91-180	86,3	25,0	0,0	10,0	15,0	66,3	10,0
>180	42,8	48,7	20,0	0,0	8,7	22,8	20,0
<b>Total</b>	<b>997,1</b>	<b>859,9</b>	<b>369,6</b>	<b>262,1</b>	<b>219,3</b>	<b>464,0</b>	<b>271,0</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	2,7 %	3,1 %	2,7 %	2,9 %
15-35	2,5 %	2,9 %	3,1 %	2,8 %
36-60	3,4 %	3,4 %	2,9 %	3,2 %
61-90	-	3,3 %	3,0 %	3,2 %
91-180	3,4 %	3,2 %	3,1 %	3,1 %
>180	1,8 %	3,4 %	2,8 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>2,9 %</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	11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre				25 al 29 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	126	3281	2641	37	83	2836	2918	20	95	1680	2247
Intragrupa y off-shore***	0	0	1266	968	0	0	1273	621	0	0	1075	390
Otros	126	20	495	1434	83	37	528	1098	95	20	528	645
<b>Total</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>5043</b>	<b>5043</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>4637</b>	<b>4637</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>3282</b>	<b>3282</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.