

Fecha de Publicación: 09 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 05 de diciembre 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\$1313,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.<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	167,1	96,7	27,0	113,0	22,7	7,1	47,0
15-35	318,6	401,7	231,0	160,0	26,6	14,5	144,1
36-60	237,8	171,4	120,0	0,0	51,4	237,8	0,0
61-90	42,2	3,9	0,0	0,0	3,9	42,2	0,0
91-180	0,1	20,7	0,0	0,0	20,7	0,1	0,0
>180	2,6	41,4	0,0	0,0	41,4	2,6	0,0
<b>Total</b>	<b>768,5</b>	<b>735,8</b>	<b>378,0</b>	<b>273,0</b>	<b>166,7</b>	<b>304,4</b>	<b>191,1</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	2,4 %	4,7 %	3,3 %	3,4 %
15-35	2,3 %	3,0 %	3,3 %	2,8 %
36-60	-	3,5 %	3,3 %	3,4 %
61-90	-	5,5 %	3,3 %	3,5 %
91-180	-	3,7 %	2,9 %	3,7 %
>180	-	3,5 %	3,3 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>2,3 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,2 %</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	2 al 6 de diciembre				9 al 13 de diciembre				16 al 20 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	77	4791	4633	14	78	3276	3498	19	127	3147	3708
Intragrupa y off-shore***	0	1	2242	1437	0	0	1551	918	0	0	1532	565
Otros	77	23	440	1403	78	14	678	1088	127	19	568	973
<b>Total</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>7473</b>	<b>7473</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>5504</b>	<b>5504</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>5247</b>	<b>5247</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.