

Fecha de Publicación: 11 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 09 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\$1159,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.<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	333,7	177,0	60,0	154,0	4,8	67,5	112,2
15-35	330,4	344,5	153,0	159,0	28,5	8,4	163,0
36-60	92,5	79,5	28,0	0,0	42,5	83,5	9,0
61-90	24,8	20,8	0,0	0,0	0,8	4,8	20,0
91-180	5,1	16,8	5,0	0,0	11,8	5,1	0,0
>180	33,0	39,0	0,0	0,0	6,0	0,0	33,0
<b>Total</b>	<b>819,4</b>	<b>677,6</b>	<b>246,0</b>	<b>313,0</b>	<b>94,4</b>	<b>169,2</b>	<b>337,2</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	-2,2 %	3,2 %	2,3 %	1,2 %
15-35	2,4 %	3,5 %	3,0 %	2,9 %
36-60	3,5 %	3,1 %	3,1 %	3,2 %
61-90	3,3 %	3,7 %	3,2 %	3,3 %
91-180	-	3,5 %	3,1 %	3,4 %
>180	3,3 %	3,0 %	3,0 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>1,0 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>2,4 %</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	9 al 13 de diciembre				16 al 20 de diciembre				23 al 27 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	84	3589	3672	27	128	3387	3802	5	104	1454	2496
Intragrupa y off-shore***	0	0	1633	1058	0	0	1546	600	0	0	1619	605
Otros	84	24	674	1165	128	27	571	1102	104	5	299	271
<b>Total</b>	<b>109</b>	<b>109</b>	<b>5896</b>	<b>5896</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>5504</b>	<b>5504</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>3372</b>	<b>3372</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.