

Fecha de Publicación: 23 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 19 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\$1399,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.<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	193,2	76,5	10,0	125,3	11,5	13,0	55,0
15-35	570,0	590,1	253,0	64,3	58,6	227,2	278,5
36-60	16,7	5,1	0,0	0,0	5,1	16,7	0,0
61-90	61,2	74,3	0,0	0,0	69,3	56,2	5,0
91-180	40,7	26,5	0,0	0,0	11,5	25,7	15,0
>180	84,7	58,7	10,0	35,0	3,7	4,7	45,0
<b>Total</b>	<b>966,5</b>	<b>831,4</b>	<b>273,0</b>	<b>224,6</b>	<b>159,9</b>	<b>343,4</b>	<b>398,5</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	13,8 %	1,6 %	0,4 %	4,2 %
15-35	3,3 %	1,5 %	1,6 %	2,1 %
36-60	-	2,9 %	1,6 %	1,9 %
61-90	2,5 %	2,3 %	2,7 %	2,4 %
91-180	1,2 %	2,9 %	1,5 %	1,7 %
>180	2,6 %	3,0 %	2,9 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>4,6 %</b>	<b>1,7 %</b>	<b>1,5 %</b>	<b>2,5 %</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	16 al 20 de diciembre				23 al 27 de diciembre				30 de dic. al 3 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	46	121	5146	4806	8	105	2150	2752	6	28	1434	1969
Intragrupa y off-shore***	0	0	1981	1545	0	0	1754	1137	0	0	1308	743
Otros	121	46	687	1462	105	8	282	298	28	6	172	202
<b>Total</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>7814</b>	<b>7814</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>4187</b>	<b>4187</b>	<b>34</b>	<b>34</b>	<b>2914</b>	<b>2914</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.