

Fecha de Publicación: 30 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 26 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\$1623,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.<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	224,3	158,3	81,0	145,0	2,3	4,3	75,0
15-35	409,1	523,6	165,1	92,5	51,5	9,6	307,0
36-60	65,4	94,9	40,0	0,0	54,9	65,4	0,0
61-90	47,6	215,9	30,0	0,0	150,9	12,6	35,0
91-180	117,1	190,9	10,0	0,0	130,9	67,1	50,0
>180	30,8	37,2	10,0	0,0	2,2	5,8	25,0
<b>Total</b>	<b>894,3</b>	<b>1220,8</b>	<b>336,1</b>	<b>237,5</b>	<b>392,8</b>	<b>164,8</b>	<b>492,0</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	0,0 %	2,3 %	-0,5 %	-0,3 %
15-35	0,1 %	0,1 %	0,1 %	0,1 %
36-60	-	1,1 %	1,8 %	1,4 %
61-90	0,9 %	2,1 %	1,3 %	1,9 %
91-180	1,9 %	2,4 %	0,9 %	1,9 %
>180	2,7 %	3,0 %	2,9 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>1,4 %</b>	<b>0,4 %</b>	<b>0,9 %</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**

Sector	23 al 27 de diciembre				30 de dic. al 3 de enero				6 al 10 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	109	2504	3158	8	35	1558	2206	49	55	2779	3540
Intragrupa y off-shore***	0	0	1816	1356	0	0	1470	799	0	0	2154	1058
Otros	108	20	567	372	35	8	189	213	55	49	499	834
<b>Total</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>4886</b>	<b>4886</b>	<b>43</b>	<b>43</b>	<b>3218</b>	<b>3218</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>5432</b>	<b>5432</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.