

Fecha de Publicación: 28 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 27 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\$1046,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.<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	328,1	151,1	98,0	270,0	23,1	28,1	30,0
15-35	233,9	335,7	266,5	193,0	39,1	10,8	30,1
36-60	7,7	19,0	15,0	0,0	4,0	7,7	0,0
61-90	11,6	2,6	0,0	10,0	2,6	1,6	0,0
91-180	0,4	7,5	0,0	0,0	7,5	0,4	0,0
>180	5,0	4,4	0,0	5,0	4,4	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>586,7</b>	<b>520,2</b>	<b>379,5</b>	<b>478,0</b>	<b>80,6</b>	<b>48,6</b>	<b>60,1</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	0,6 %	0,4 %	0,1 %	0,2 %
15-35	0,2 %	0,4 %	0,0 %	0,2 %
36-60	-	0,8 %	0,5 %	0,7 %
61-90	-	0,0 %	1,5 %	0,6 %
91-180	-	2,6 %	1,8 %	2,6 %
>180	-	3,8 %	2,7 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>0,4 %</b>	<b>0,5 %</b>	<b>0,1 %</b>	<b>0,3 %</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	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	36	1762	2285	51	56	2902	3611
Intragrupa y off-shore***	0	0	1816	1356	0	0	1518	978	0	0	2204	1149
Otros	109	20	567	372	35	8	200	218	56	51	509	856
<b>Total</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>4886</b>	<b>4886</b>	<b>44</b>	<b>44</b>	<b>3481</b>	<b>3481</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>5616</b>	<b>5616</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.