

Fecha de Publicación: 19 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 15 de noviembre 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\$1449,0 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	475,8	343,9	111,0	153,0	7,9	97,8	225,0
15-35	422,4	437,2	187,5	85,5	22,7	109,9	227,0
36-60	62,4	73,4	0,0	0,0	13,4	2,4	60,0
61-90	18,3	11,4	0,0	0,0	11,4	18,3	0,0
91-180	80,8	5,9	0,0	0,0	5,9	80,8	0,0
>180	7,4	22,3	0,0	0,0	22,3	7,4	0,0
<b>Total</b>	<b>1067,1</b>	<b>893,9</b>	<b>298,5</b>	<b>238,5</b>	<b>83,5</b>	<b>316,6</b>	<b>512,0</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	2,4 %	2,2 %	1,7 %	2,1 %
15-35	2,4 %	3,3 %	3,1 %	2,8 %
36-60	0,0 %	3,6 %	2,9 %	0,7 %
61-90	-	3,5 %	3,0 %	3,2 %
91-180	-	3,7 %	3,1 %	3,2 %
>180	-	3,3 %	3,1 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>2,1 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>2,4 %</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	11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre				25 al 29 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	124	3390	2687	43	90	3426	3261	21	94	2051	2529
Intragrupa y off-shore***	0	0	1300	1029	0	0	1455	810	0	0	1108	394
Otros	124	19	508	1482	90	43	542	1351	94	21	575	810
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>5198</b>	<b>5198</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>5423</b>	<b>5423</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>3734</b>	<b>3734</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.