

Fecha de Publicación: 28 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 26 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\$2002,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.<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	369,7	480,3	226,7	108,7	93,6	101,0	160,0
15-35	497,3	709,7	480,5	130,5	25,8	163,4	203,4
36-60	110,4	109,4	0,0	0,0	29,4	30,4	80,0
61-90	25,4	35,4	20,0	10,0	15,4	15,4	0,0
91-180	28,6	63,5	0,0	0,0	58,5	23,6	5,0
>180	0,2	21,0	0,0	0,0	21,0	0,2	0,0
<b>Total</b>	<b>1031,6</b>	<b>1419,3</b>	<b>727,2</b>	<b>249,2</b>	<b>243,7</b>	<b>334,0</b>	<b>448,4</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 %	3,3 %	3,1 %	3,0 %
15-35	2,3 %	2,9 %	3,1 %	2,8 %
36-60	0,8 %	3,5 %	3,2 %	1,9 %
61-90	-	3,6 %	3,2 %	3,4 %
91-180	3,3 %	3,6 %	3,2 %	3,5 %
>180	-	3,4 %	3,2 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>2,0 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,9 %</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	25 al 29 de noviembre				2 al 6 de diciembre				9 al 13 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	94	3062	3154	28	66	3596	4093	7	74	2395	2734
Intragrupa y off-shore***	0	0	1333	783	0	0	2064	737	0	0	1283	718
Otros	94	24	640	1099	66	28	443	1273	74	7	591	816
<b>Total</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>5035</b>	<b>5035</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>6103</b>	<b>6103</b>	<b>81</b>	<b>81</b>	<b>4269</b>	<b>4269</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.