

Fecha de Publicación: 5 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 03 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\$1420,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	188,7	216,8	136,3	73,3	11,5	46,4	69,0
15-35	337,0	445,7	316,3	108,5	9,5	108,5	120,0
36-60	189,4	74,5	10,0	0,0	39,5	164,4	25,0
61-90	40,0	55,8	50,0	30,0	0,8	5,0	5,0
91-180	40,2	8,7	0,0	0,0	8,7	40,2	0,0
>180	42,2	13,0	0,0	0,0	0,0	29,2	13,0
<b>Total</b>	<b>837,3</b>	<b>814,6</b>	<b>512,5</b>	<b>211,8</b>	<b>70,1</b>	<b>393,6</b>	<b>232,0</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	1,5 %	3,6 %	3,1 %	3,0 %
15-35	3,6 %	3,6 %	3,4 %	3,5 %
36-60	3,6 %	3,4 %	3,2 %	3,3 %
61-90	3,4 %	3,4 %	3,2 %	3,4 %
91-180	-	3,6 %	3,2 %	3,3 %
>180	2,7 %	-	3,1 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,3 %</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**

Sector	2 al 6 de diciembre				9 al 13 de diciembre				16 al 20 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	56	72	4405	4537	14	78	3021	3284	14	120	3025	3601
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	26	2200	1124	0	0	1414	764	0	0	1483	495
<b>Otros</b>	72	30	446	1389	78	14	661	1047	120	14	552	964
<b>Total</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>7051</b>	<b>7051</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>5095</b>	<b>5095</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>5060</b>	<b>5060</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.