

Fecha de Publicación: 5 de octubre de 2013

Fecha de Información: 03 de octubre 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\$1385,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.<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         | 440,3               | 335,4        | 150,2                     | 95,5         | 40,2          | 199,8        | 145,0          |
| 15-35        | 343,1               | 430,0        | 223,5                     | 129,5        | 45,8          | 52,8         | 160,8          |
| 36-60        | 3,2                 | 6,3          | 0,0                       | 0,0          | 6,3           | 3,2          | 0,0            |
| 61-90        | 26,0                | 32,5         | 0,0                       | 0,0          | 12,5          | 6,0          | 20,0           |
| 91-180       | 44,2                | 35,1         | 15,0                      | 0,0          | 20,1          | 44,2         | 0,0            |
| >180         | 5,8                 | 10,8         | 0,0                       | 0,0          | 8,8           | 3,8          | 2,0            |
| <b>Total</b> | <b>862,6</b>        | <b>850,1</b> | <b>388,7</b>              | <b>225,0</b> | <b>133,6</b>  | <b>309,8</b> | <b>327,8</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         | 2,5 %              | 2,4 %                        | 2,8 %        | 2,6 %        |
| 15-35        | 2,2 %              | 3,0 %                        | 2,7 %        | 2,7 %        |
| 36-60        | -                  | 3,8 %                        | 2,3 %        | 3,3 %        |
| 61-90        | 3,0 %              | 2,3 %                        | 2,9 %        | 2,8 %        |
| 91-180       | -                  | 3,2 %                        | 3,0 %        | 3,1 %        |
| >180         | 0,0 %              | 3,4 %                        | 2,9 %        | 2,8 %        |
| <b>Total</b> | <b>2,4 %</b>       | <b>2,8 %</b>                 | <b>2,8 %</b> | <b>2,7 %</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                  | 30 de sep. al 4 de octubre |            |             |             | 7 al 11 de octubre |            |             |             | 14 al 18 de octubre |            |             |             |
|---------------------------|----------------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
|                           | Delivery                   |            | NDF         |             | Delivery           |            | NDF         |             | Delivery            |            | NDF         |             |
|                           | C                          | V          | C           | V           | C                  | V          | C           | V           | C                   | V          | C           | V           |
| Sector Financiero**       | 17                         | 84         | 3640        | 3256        | 24                 | 84         | 3999        | 4167        | 44                  | 115        | 2473        | 2009        |
| Intragrupa y off-shore*** | 0                          | 0          | 1604        | 1065        | 0                  | 1          | 2123        | 1161        | 0                   | 0          | 899         | 794         |
| Otros                     | 84                         | 17         | 596         | 1517        | 84                 | 23         | 622         | 1416        | 115                 | 44         | 345         | 915         |
| <b>Total</b>              | <b>101</b>                 | <b>101</b> | <b>5839</b> | <b>5839</b> | <b>107</b>         | <b>107</b> | <b>6745</b> | <b>6745</b> | <b>159</b>          | <b>159</b> | <b>3718</b> | <b>3718</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.