

Fecha de Publicación: 8 de octubre de 2013

Fecha de Información: 04 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\$759,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,3%.<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	87,6	39,0	26,5	53,4	2,5	24,2	10,0
15-35	399,1	182,9	31,0	96,0	4,9	156,1	147,0
36-60	0,7	8,8	0,0	0,0	8,8	0,7	0,0
61-90	65,7	84,6	15,0	0,0	4,6	0,7	65,0
91-180	28,2	39,5	0,0	0,0	19,5	8,2	20,0
>180	41,3	64,2	20,0	0,0	4,2	1,3	40,0
<b>Total</b>	<b>622,5</b>	<b>419,0</b>	<b>92,5</b>	<b>149,4</b>	<b>44,5</b>	<b>191,1</b>	<b>282,0</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	3,3 %	2,2 %	1,8 %	2,0 %
15-35	1,6 %	3,4 %	2,5 %	2,2 %
36-60	-	3,9 %	2,6 %	3,8 %
61-90	2,5 %	3,1 %	2,8 %	2,7 %
91-180	1,5 %	3,4 %	3,0 %	2,5 %
>180	2,0 %	3,2 %	3,0 %	2,5 %
<b>Total</b>	<b>1,9 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,4 %</b>	<b>2,3 %</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	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**	19	84	3640	3256	23	82	4077	4200	44	115	2493	2017
Intragrupa y off-shore***	0	1	1604	1065	0	0	2143	1204	0	0	906	804
Otros	84	18	596	1517	82	23	625	1440	114	44	347	925
<b>Total</b>	<b>102</b>	<b>102</b>	<b>5839</b>	<b>5839</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>6845</b>	<b>6845</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>3746</b>	<b>3746</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.