

Fecha de Publicación: 25 de octubre de 2013

Fecha de Información: 23 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\$1517,1 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	578,0	244,5	149,5	134,5	2,7	351,3	92,2
15-35	274,8	471,6	291,0	46,0	15,7	63,9	164,9
36-60	110,8	102,7	1,1	0,0	30,6	39,8	71,0
61-90	13,5	13,5	0,0	0,0	3,5	3,5	10,0
91-180	10,5	20,1	10,0	0,0	10,1	10,5	0,0
>180	12,3	15,0	0,0	0,0	3,0	0,3	12,0
<b>Total</b>	<b>999,9</b>	<b>867,3</b>	<b>451,6</b>	<b>180,5</b>	<b>65,6</b>	<b>469,3</b>	<b>350,1</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	2,7 %	2,8 %	2,8 %	2,8 %
15-35	3,0 %	3,2 %	2,9 %	3,1 %
36-60	3,3 %	3,2 %	3,1 %	3,2 %
61-90	3,4 %	3,7 %	3,0 %	3,4 %
91-180	-	3,4 %	3,0 %	3,2 %
>180	0,0 %	0,8 %	2,6 %	0,2 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,8 %</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	21 al 25 de octubre				28 de oct. al 1 de noviembre				4 al 8 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	74	94	4439	3561	14	108	3049	2904	5	67	2173	2473
Intragrupa y off-shore***	0	0	2073	1606	0	0	1165	927	0	0	1270	710
Otros	94	74	354	1699	108	14	749	1132	67	5	427	687
<b>Total</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>6866</b>	<b>6866</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>4963</b>	<b>4963</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>3871</b>	<b>3871</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.