

Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 17 de septiembre 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\$1294,8 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	446,0	316,1	118,5	214,3	12,6	46,7	185,0
15-35	442,1	179,2	40,3	248,0	3,9	59,1	135,0
36-60	2,7	12,7	0,0	0,0	12,7	2,7	0,0
61-90	0,1	6,7	0,0	0,0	6,7	0,1	0,0
91-180	79,3	39,4	0,0	20,0	14,3	34,3	25,0
>180	80,7	114,9	30,0	0,0	4,9	0,7	80,0
<b>Total</b>	<b>1050,9</b>	<b>669,0</b>	<b>188,8</b>	<b>482,3</b>	<b>55,2</b>	<b>143,5</b>	<b>425,0</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	5,6 %	4,1 %	2,5 %	4,1 %
15-35	3,1 %	3,1 %	2,1 %	2,4 %
36-60	-	3,3 %	2,8 %	3,2 %
61-90	-	3,4 %	2,7 %	3,4 %
91-180	3,2 %	3,3 %	3,0 %	3,1 %
>180	2,9 %	3,1 %	3,0 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>2,3 %</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	16 al 20 de septiembre				23 al 27 de septiembre				30 de sep. al 4 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	86	88	4003	3393	32	89	2980	3131	9	45	1678	2255
Intragrupa y off-shore***	4	0	1736	1263	0	0	1848	977	0	0	1261	493
Otros	84	86	496	1579	89	32	603	1324	45	9	435	627
<b>Total</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>6235</b>	<b>6235</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>5431</b>	<b>5431</b>	<b>54</b>	<b>54</b>	<b>3374</b>	<b>3374</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.