

Fecha de Publicación: 25 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 23 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\$1412,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.<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         | 502,8               | 175,7        | 66,3                      | 218,6        | 24,4          | 199,2        | 85,0           |
| 15-35        | 415,9               | 330,7        | 199,5                     | 133,6        | 18,2          | 169,2        | 113,0          |
| 36-60        | 20,7                | 90,4         | 0,0                       | 0,0          | 90,4          | 20,7         | 0,0            |
| 61-90        | 2,6                 | 18,6         | 0,0                       | 0,0          | 18,6          | 2,6          | 0,0            |
| 91-180       | 21,5                | 30,5         | 0,0                       | 0,0          | 23,3          | 14,2         | 7,3            |
| >180         | 0,0                 | 8,3          | 0,0                       | 0,0          | 8,3           | 0,0          | 0,0            |
| <b>Total</b> | <b>963,5</b>        | <b>654,4</b> | <b>265,8</b>              | <b>352,2</b> | <b>183,3</b>  | <b>406,1</b> | <b>205,3</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         | 1,0 %              | 3,5 %                        | 2,4 %        | 2,4 %        |
| 15-35        | 2,2 %              | 2,7 %                        | 2,6 %        | 2,5 %        |
| 36-60        | -                  | 3,2 %                        | 2,7 %        | 3,1 %        |
| 61-90        | -                  | 3,3 %                        | 3,9 %        | 3,4 %        |
| 91-180       | 3,0 %              | 2,9 %                        | 1,8 %        | 2,6 %        |
| >180         | -                  | 3,0 %                        | 2,8 %        | 3,0 %        |
| <b>Total</b> | <b>1,7 %</b>       | <b>3,0 %</b>                 | <b>2,5 %</b> | <b>2,5 %</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                  | 23 al 27 de septiembre |           |             |             | 30 de sep. al 4 de octubre |            |             |             | 7 al 11 de octubre |           |             |             |
|---------------------------|------------------------|-----------|-------------|-------------|----------------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|-----------|-------------|-------------|
|                           | Delivery               |           | NDF         |             | Delivery                   |            | NDF         |             | Delivery           |           | NDF         |             |
|                           | C                      | V         | C           | V           | C                          | V          | C           | V           | C                  | V         | C           | V           |
| Sector Financiero**       | 15                     | 75        | 3975        | 3442        | 14                         | 90         | 2049        | 2526        | 10                 | 71        | 2615        | 2767        |
| Intragrupa y off-shore*** | 0                      | 0         | 1897        | 1418        | 0                          | 0          | 1369        | 571         | 0                  | 0         | 1585        | 921         |
| Otros                     | 74                     | 15        | 645         | 1656        | 90                         | 14         | 539         | 861         | 71                 | 10        | 466         | 979         |
| <b>Total</b>              | <b>89</b>              | <b>89</b> | <b>6516</b> | <b>6516</b> | <b>104</b>                 | <b>104</b> | <b>3957</b> | <b>3957</b> | <b>82</b>          | <b>82</b> | <b>4666</b> | <b>4666</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.