

Fecha de Publicación: 30 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 26 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\$1688,2 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	645,7	431,6	44,0	50,3	38,6	246,5	349,0
15-35	331,3	573,9	313,0	23,0	62,9	110,3	198,0
36-60	31,5	9,1	0,0	0,0	9,1	31,5	0,0
61-90	96,1	75,3	42,1	15,0	3,2	51,1	30,0
91-180	23,1	13,5	0,0	0,0	13,5	23,1	0,0
>180	15,1	34,0	4,9	0,0	14,1	0,1	15,0
<b>Total</b>	<b>1142,7</b>	<b>1137,5</b>	<b>404,0</b>	<b>88,3</b>	<b>141,5</b>	<b>462,5</b>	<b>592,0</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	2,3 %	3,5 %	2,6 %	2,5 %
15-35	2,6 %	3,1 %	2,7 %	2,9 %
36-60	-	3,3 %	2,8 %	2,9 %
61-90	3,1 %	3,2 %	2,8 %	2,9 %
91-180	-	3,5 %	2,8 %	3,1 %
>180	3,2 %	3,1 %	2,9 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,7 %</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**

Sector	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**	14	80	4571	3688	17	91	2508	2664	11	76	3085	3239		
Intragrupa y off-shore***	0	0	1947	1644	0	0	1385	770	0	0	1707	1013		
Otros	80	14	649	1836	91	17	564	1023	76	11	563	1104		
<b>Total</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>7168</b>	<b>7168</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>4457</b>	<b>4457</b>	<b>87</b>	<b>87</b>	<b>5356</b>	<b>5356</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.