

Fecha de Publicación: 1 de octubre de 2013

Fecha de Información: 27 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\$1605,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.<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	410,2	399,5	207,0	10,1	12,9	220,5	179,6
15-35	452,2	300,3	119,5	311,0	80,5	40,9	100,3
36-60	122,5	1,1	0,0	80,0	1,1	42,5	0,0
61-90	19,0	30,0	25,0	0,0	5,0	19,0	0,0
91-180	48,4	47,6	0,0	0,0	12,6	13,4	35,0
>180	88,0	81,5	0,0	2,1	1,6	6,1	79,9
<b>Total</b>	<b>1140,2</b>	<b>859,9</b>	<b>351,5</b>	<b>403,1</b>	<b>113,6</b>	<b>342,3</b>	<b>394,8</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	5,1 %	3,1 %	2,0 %	3,3 %
15-35	3,9 %	3,3 %	2,4 %	2,9 %
36-60	-	3,8 %	3,0 %	3,0 %
61-90	-	3,3 %	2,9 %	3,2 %
91-180	3,8 %	3,4 %	2,8 %	3,5 %
>180	3,2 %	3,5 %	2,6 %	3,1 %
<b>Total</b>	<b>4,3 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,4 %</b>	<b>3,1 %</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	Vencimientos de Forwards											
	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	77	4571	3691	19	93	2849	2866	13	76	3149	3436
Intragrupa y off-shore***	0	0	1947	1644	0	0	1442	773	0	1	1857	1019
Otros	77	15	653	1836	93	19	569	1221	76	12	571	1122
<b>Total</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>7171</b>	<b>7171</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>4860</b>	<b>4860</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>5578</b>	<b>5578</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.