

Fecha de Publicación: 11 de octubre de 2013

Fecha de Información: 09 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\$1367,7 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	217,0	137,1	93,0	7,0	4,1	170,0	40,0
15-35	362,3	472,7	190,1	62,0	3,6	21,3	279,0
36-60	28,8	91,1	0,0	0,0	66,1	3,8	25,0
61-90	56,0	84,8	40,0	20,0	14,8	6,0	30,0
91-180	111,7	90,7	0,0	2,2	3,6	22,4	87,2
>180	131,9	170,6	42,0	0,0	2,6	5,9	126,0
<b>Total</b>	<b>907,8</b>	<b>1047,1</b>	<b>365,1</b>	<b>91,2</b>	<b>94,9</b>	<b>229,4</b>	<b>587,2</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	2,9 %	2,7 %	2,9 %	2,9 %
15-35	2,7 %	3,2 %	2,9 %	2,9 %
36-60	0,0 %	3,3 %	3,2 %	2,4 %
61-90	3,2 %	3,2 %	3,2 %	3,2 %
91-180	3,3 %	3,5 %	3,0 %	3,2 %
>180	2,7 %	3,5 %	3,0 %	2,7 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,9 %</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**

Sectores	7 al 11 de octubre				14 al 18 de octubre				21 al 25 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	49	80	4428	4503	45	122	2633	2154	69	84	2548	2517
Intragrupa y off-shore***	0	0	2318	1239	0	0	1022	814	0	0	1522	980
Otros	80	49	658	1662	122	45	367	1055	84	69	324	897
<b>Total</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>7405</b>	<b>7405</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>4023</b>	<b>4023</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>4394</b>	<b>4394</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.