

Fecha de Publicación: 18 de octubre de 2013

Fecha de Información: 16 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\$1521,1 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         | 405,9               | 242,5        | 188,0                     | 210,0        | 9,5           | 150,9        | 45,0           |
| 15-35        | 428,3               | 267,4        | 133,7                     | 196,0        | 68,7          | 167,3        | 65,0           |
| 36-60        | 55,1                | 123,9        | 0,0                       | 0,0          | 83,9          | 15,1         | 40,0           |
| 61-90        | 1,0                 | 32,3         | 0,0                       | 0,0          | 32,3          | 1,0          | 0,0            |
| 91-180       | 35,1                | 58,0         | 0,4                       | 0,0          | 57,6          | 35,1         | 0,0            |
| >180         | 13,5                | 18,0         | 1,4                       | 0,0          | 6,6           | 3,5          | 10,0           |
| <b>Total</b> | <b>938,9</b>        | <b>742,2</b> | <b>323,5</b>              | <b>406,0</b> | <b>258,6</b>  | <b>372,9</b> | <b>160,0</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         | 2,9 %              | 2,5 %                        | 2,9 %        | 2,8 %        |
| 15-35        | 3,1 %              | 3,3 %                        | 2,8 %        | 3,0 %        |
| 36-60        | 2,1 %              | 3,5 %                        | 2,8 %        | 3,0 %        |
| 61-90        | -                  | 3,5 %                        | 2,6 %        | 3,5 %        |
| 91-180       | -                  | 3,5 %                        | 3,1 %        | 3,4 %        |
| >180         | 0,0 %              | 3,1 %                        | 3,1 %        | 1,6 %        |
| <b>Total</b> | <b>2,6 %</b>       | <b>3,1 %</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                  | 14 al 18 de octubre |            |             |             | 21 al 25 de octubre |            |             |             | 28 de oct. al 1 de noviembre |            |             |             |
|---------------------------|---------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|------------------------------|------------|-------------|-------------|
|                           | Delivery            |            | NDF         |             | Delivery            |            | NDF         |             | Delivery                     |            | NDF         |             |
|                           | C                   | V          | C           | V           | C                   | V          | C           | V           | C                            | V          | C           | V           |
| Sector Financiero**       | 48                  | 118        | 3312        | 2469        | 71                  | 99         | 3022        | 2883        | 14                           | 97         | 2547        | 2636        |
| Intragrupa y off-shore*** | 0                   | 0          | 1235        | 960         | 0                   | 0          | 1662        | 1110        | 0                            | 0          | 1003        | 858         |
| Otros                     | 117                 | 48         | 385         | 1502        | 99                  | 71         | 356         | 1047        | 97                           | 14         | 737         | 794         |
| <b>Total</b>              | <b>165</b>          | <b>165</b> | <b>4932</b> | <b>4932</b> | <b>170</b>          | <b>170</b> | <b>5041</b> | <b>5041</b> | <b>111</b>                   | <b>111</b> | <b>4288</b> | <b>4288</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.