

Fecha de Publicación: 28 de octubre de 2013

Fecha de Información: 24 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\$1533,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.<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	642,4	568,5	265,6	50,0	39,9	329,4	263,0
15-35	200,1	315,1	119,0	70,8	79,1	12,3	117,0
36-60	77,4	11,7	0,0	0,0	11,7	77,4	0,0
61-90	1,4	3,2	0,0	0,0	3,2	1,4	0,0
91-180	62,8	53,6	0,0	30,0	23,6	2,8	30,0
>180	3,8	3,5	0,0	0,0	3,5	3,8	0,0
<b>Total</b>	<b>987,8</b>	<b>955,6</b>	<b>384,6</b>	<b>150,8</b>	<b>161,0</b>	<b>427,1</b>	<b>410,0</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	2,4 %	2,7 %	2,8 %	2,6 %
15-35	2,3 %	3,1 %	2,8 %	2,8 %
36-60	-	3,8 %	2,9 %	3,0 %
61-90	-	3,9 %	3,0 %	3,6 %
91-180	3,4 %	3,4 %	3,3 %	3,4 %
>180	-	3,4 %	2,9 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>2,8 %</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	21 al 25 de octubre				28 de oct. al 1 de noviembre				4 al 8 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	75	94	4651	3673	14	109	3383	3238	5	67	2301	2626
Intragrupa y off-shore***	0	0	2083	1606	0	0	1365	937	0	0	1326	750
Otros	94	75	355	1811	109	14	775	1348	67	5	439	690
<b>Total</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>7090</b>	<b>7090</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>5523</b>	<b>5523</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>4066</b>	<b>4066</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.