

Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2013

Fecha de Información: 25 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\$1486,5 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	833,9	442,7	134,8	74,8	17,0	468,2	291,0
15-35	205,4	275,0	140,0	60,0	9,0	19,4	126,0
36-60	8,1	5,3	2,5	0,0	2,8	8,1	0,0
61-90	0,6	1,1	0,0	0,0	1,1	0,6	0,0
91-180	0,6	19,0	0,0	0,0	19,0	0,6	0,0
>180	110,0	91,8	0,0	20,0	1,8	0,0	90,0
<b>Total</b>	<b>1158,6</b>	<b>834,9</b>	<b>277,3</b>	<b>154,8</b>	<b>50,6</b>	<b>496,9</b>	<b>507,0</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	2,6 %	3,1 %	3,0 %	2,9 %
15-35	1,4 %	3,6 %	3,1 %	2,7 %
36-60	-	3,4 %	3,0 %	3,1 %
61-90	-	3,6 %	2,8 %	3,3 %
91-180	-	3,5 %	2,5 %	3,5 %
>180	1,8 %	3,5 %	3,3 %	2,1 %
<b>Total</b>	<b>2,2 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,0 %</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	92	4651	3671	14	116	4074	3500	5	67	2445	2800
Intragrupa y off-shore***	0	0	2083	1606	0	0	1439	967	0	0	1387	795
Otros	92	75	354	1811	116	14	770	1816	67	5	454	690
<b>Total</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>7088</b>	<b>7088</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>6283</b>	<b>6283</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>4286</b>	<b>4286</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.