

Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2013

Fecha de Información: 22 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\$1775,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	606,2	171,1	131,2	293,5	4,9	277,7	35,0
15-35	338,7	539,2	389,9	107,4	83,4	165,4	65,9
36-60	58,0	6,7	0,0	25,0	6,7	33,0	0,0
61-90	0,0	13,8	0,0	0,0	13,8	0,0	0,0
91-180	27,0	18,1	0,0	0,0	18,1	27,0	0,0
>180	27,0	85,3	65,0	10,0	5,3	2,0	15,0
<b>Total</b>	<b>1056,9</b>	<b>834,2</b>	<b>586,1</b>	<b>435,8</b>	<b>132,2</b>	<b>505,2</b>	<b>115,9</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	2,2 %	4,5 %	3,4 %	3,5 %
15-35	2,7 %	3,0 %	2,9 %	2,9 %
36-60	-	3,6 %	3,0 %	3,1 %
61-90	-	3,3 %	-	3,3 %
91-180	-	3,4 %	3,1 %	3,2 %
>180	2,2 %	3,2 %	3,2 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>2,5 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,2 %</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
<b>Sector Financiero**</b>	74	98	3955	3407	14	108	2982	2886	5	67	2114	2339
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1986	1503	0	0	1150	895	0	0	1173	700
<b>Otros</b>	98	74	351	1382	108	14	746	1097	67	5	427	674
<b>Total</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>6292</b>	<b>6292</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>4878</b>	<b>4878</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>3714</b>	<b>3714</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.