

Fecha de Publicación: 9 de agosto de 2013

Fecha de Información: 06 de agosto 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\$2355,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.<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	417,0	340,0	205,5	279,1	17,5	20,9	117,0
15-35	298,7	332,3	247,0	175,0	4,3	42,7	81,0
36-60	0,1	103,4	0,0	0,0	103,4	0,1	0,0
61-90	2,0	3,0	0,0	0,0	3,0	2,0	0,0
91-180	0,0	79,5	45,0	0,0	34,5	0,0	0,0
>180	511,1	528,7	20,0	4,4	446,7	444,7	62,0
<b>Total</b>	<b>1228,9</b>	<b>1387,0</b>	<b>517,5</b>	<b>458,5</b>	<b>609,5</b>	<b>510,4</b>	<b>260,0</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	1,9 %	3,5 %	2,7 %	2,8 %
15-35	4,0 %	3,5 %	3,3 %	3,5 %
36-60	-	4,3 %	3,4 %	4,3 %
61-90	-	4,2 %	3,6 %	3,9 %
91-180	-	2,9 %	-	2,9 %
>180	0,6 %	0,2 %	0,0 %	0,1 %
<b>Total</b>	<b>2,3 %</b>	<b>2,0 %</b>	<b>1,5 %</b>	<b>1,8 %</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

Sector	5 al 9 de agosto				12 al 16 de agosto				19 al 23 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	68	3315	3274	18	176	3271	3077	9	86	1966	2380
Intragrupa y off-shore***	0	0	1719	1137	0	0	1944	1251	0	0	1578	560
Otros	68	17	477	1100	176	18	529	1417	86	9	292	896
<b>Total</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>5511</b>	<b>5511</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>5744</b>	<b>5744</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>3836</b>	<b>3836</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.