

Fecha de Publicación: 15 de agosto de 2013

Fecha de Información: 13 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\$1500,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.<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	370,1	174,8	88,5	227,5	9,3	65,6	77,0
15-35	585,2	525,7	319,7	126,2	33,0	286,0	173,0
36-60	3,4	17,7	15,0	0,0	2,7	3,4	0,0
61-90	20,4	9,9	0,0	0,0	9,9	20,4	0,0
91-180	0,8	26,0	0,0	0,0	26,0	0,8	0,0
>180	2,5	13,7	0,0	0,0	13,7	2,5	0,0
<b>Total</b>	<b>982,3</b>	<b>767,8</b>	<b>423,2</b>	<b>353,7</b>	<b>94,6</b>	<b>378,6</b>	<b>250,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,4 %	4,3 %	2,6 %	3,0 %
15-35	0,7 %	3,8 %	3,6 %	3,1 %
36-60	-	3,8 %	3,2 %	3,7 %
61-90	-	3,9 %	3,4 %	3,6 %
91-180	-	3,8 %	3,3 %	3,8 %
>180	-	3,7 %	3,0 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>1,6 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,1 %</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	12 al 16 de agosto				19 al 23 de agosto				26 al 30 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	185	3971	3374	10	96	2671	2872	27	88	2014	2241
Intragruppo y off-shore***	6	0	2168	1826	0	0	1871	752	0	0	1447	740
Otros	179	19	552	1491	95	10	296	1213	88	27	380	861
<b>Total</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>6691</b>	<b>6691</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>4837</b>	<b>4837</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>3841</b>	<b>3841</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 intragruppo.