

Fecha de Publicación: 16 de agosto de 2013

Fecha de Información: 14 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\$1633,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.<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	500,8	165,9	77,0	288,3	9,8	133,4	79,1
15-35	459,4	513,3	264,3	62,0	117,0	265,4	132,0
36-60	15,8	80,9	66,5	0,0	2,4	3,8	12,0
61-90	30,1	1,6	0,0	0,0	1,6	30,1	0,0
91-180	45,2	22,4	0,0	0,0	7,4	30,2	15,0
>180	17,1	19,1	11,4	10,0	7,7	7,1	0,0
<b>Total</b>	<b>1068,5</b>	<b>803,2</b>	<b>419,2</b>	<b>360,3</b>	<b>145,9</b>	<b>470,0</b>	<b>238,1</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	3,7 %	4,2 %	3,9 %	3,9 %
15-35	2,9 %	3,9 %	3,0 %	3,3 %
36-60	3,6 %	3,9 %	3,5 %	3,8 %
61-90	-	3,9 %	3,3 %	3,3 %
91-180	3,6 %	4,0 %	3,3 %	3,5 %
>180	-	3,6 %	3,4 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,6 %</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**	22	185	4112	3443	11	97	2834	2951	27	92	2281	2315
Intragrupa y off-shore***	6	0	2237	1966	0	0	1871	799	0	0	1518	841
Otros	180	22	552	1491	97	11	296	1251	92	27	383	1026
<b>Total</b>	<b>207</b>	<b>207</b>	<b>6900</b>	<b>6900</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>5001</b>	<b>5001</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>4182</b>	<b>4182</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.