

Fecha de Publicación: 28 de agosto de 2013

Fecha de Información: 26 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\$1012,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	191,9	114,8	25,1	89,6	9,7	22,3	80,0
15-35	365,3	383,0	263,5	147,9	66,5	164,4	53,0
36-60	18,6	19,0	5,0	0,0	4,0	8,6	10,0
61-90	9,6	12,0	0,0	0,0	12,0	9,6	0,0
91-180	16,0	7,4	0,0	0,0	7,4	16,0	0,0
>180	8,1	10,1	0,0	0,0	10,1	8,1	0,0
<b>Total</b>	<b>609,5</b>	<b>546,2</b>	<b>293,6</b>	<b>237,5</b>	<b>109,6</b>	<b>229,0</b>	<b>143,0</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	3,3 %	4,0 %	3,0 %	3,4 %
15-35	3,5 %	3,8 %	3,1 %	3,3 %
36-60	3,5 %	2,9 %	3,0 %	3,2 %
61-90	-	2,7 %	3,3 %	3,0 %
91-180	-	3,9 %	3,3 %	3,5 %
>180	-	3,7 %	3,1 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,7 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,3 %</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	26 al 30 de agosto				2 al 6 de septiembre				9 al 13 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	103	3085	2874	11	72	2451	2708	4	61	3008	2691
Intragrupa y off-shore***	0	0	1839	1153	0	0	1271	615	0	0	1222	719
Otros	103	30	457	1356	72	11	536	933	61	4	504	1325
<b>Total</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>5382</b>	<b>5382</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>4257</b>	<b>4257</b>	<b>65</b>	<b>65</b>	<b>4734</b>	<b>4734</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.