

Fecha de Publicación: 29 de agosto de 2013

Fecha de Información: 27 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\$1061,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	265,5	166,2	18,6	116,6	58,6	59,9	89,0
15-35	268,6	406,4	264,0	51,5	17,4	92,1	125,0
36-60	20,5	4,5	0,0	10,0	4,5	10,5	0,0
61-90	8,0	11,0	0,0	0,0	11,0	8,0	0,0
91-180	29,2	43,6	10,0	0,0	33,6	29,2	0,0
>180	34,3	29,6	10,0	0,0	8,1	22,8	11,5
<b>Total</b>	<b>626,0</b>	<b>661,1</b>	<b>302,6</b>	<b>178,1</b>	<b>133,0</b>	<b>222,4</b>	<b>225,5</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	3,5 %	5,1 %	2,4 %	3,4 %
15-35	2,7 %	4,2 %	3,1 %	3,5 %
36-60	-	4,2 %	3,4 %	3,5 %
61-90	-	3,8 %	3,1 %	3,5 %
91-180	-	3,5 %	3,1 %	3,4 %
>180	3,4 %	3,5 %	3,0 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,4 %</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	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	102	3189	2952	11	72	2608	2792	4	61	3039	2728		
Intragruppo y off-shore***	0	0	1855	1186	0	0	1273	698	0	0	1222	719		
Otros	102	30	471	1377	72	11	576	967	61	4	516	1331		
<b>Total</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>5515</b>	<b>5515</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>4457</b>	<b>4457</b>	<b>66</b>	<b>66</b>	<b>4777</b>	<b>4777</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.