

Fecha de Publicación: 30 de agosto de 2013

Fecha de Información: 28 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\$1872,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.<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	493,8	275,8	58,0	263,8	24,9	37,1	193,0
15-35	540,6	552,8	349,8	219,5	50,0	168,1	153,0
36-60	6,6	18,5	0,0	0,0	18,5	6,6	0,0
61-90	3,9	132,6	99,4	0,0	33,3	3,9	0,0
91-180	32,2	18,4	0,0	0,0	18,4	32,2	0,0
>180	83,4	89,0	55,0	47,6	5,0	6,8	29,0
<b>Total</b>	<b>1160,6</b>	<b>1087,2</b>	<b>562,2</b>	<b>530,9</b>	<b>150,1</b>	<b>254,8</b>	<b>375,0</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	1,7 %	3,2 %	3,0 %	2,5 %
15-35	3,4 %	3,7 %	3,4 %	3,5 %
36-60	-	3,9 %	3,4 %	3,8 %
61-90	-	3,6 %	3,2 %	3,6 %
91-180	-	4,1 %	3,3 %	3,6 %
>180	2,4 %	3,5 %	3,4 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>2,5 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,2 %</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**	487	546	3594	3119	11	71	2684	2886	4	61	3111	2795		
Intragrupa y off-shore***	0	4	1895	1450	0	0	1291	698	0	0	1222	734		
Otros	546	483	475	1395	71	11	582	973	61	4	534	1338		
<b>Total</b>	<b>1033</b>	<b>1033</b>	<b>5964</b>	<b>5964</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>4558</b>	<b>4558</b>	<b>66</b>	<b>66</b>	<b>4867</b>	<b>4867</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.