

Fecha de Publicación: 31 de agosto de 2013

Fecha de Información: 29 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\$1501,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	509,5	414,8	153,0	224,0	11,8	35,5	250,0
15-35	426,2	259,9	140,0	100,5	82,9	288,7	37,0
36-60	26,3	17,6	0,0	0,0	17,6	26,3	0,0
61-90	29,2	44,8	20,0	0,0	4,8	9,2	20,0
91-180	6,9	2,6	0,0	0,0	2,6	6,9	0,0
>180	38,3	58,0	4,0	4,7	28,2	7,8	25,8
<b>Total</b>	<b>1036,5</b>	<b>797,7</b>	<b>317,0</b>	<b>329,2</b>	<b>147,9</b>	<b>374,5</b>	<b>332,8</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	4,3 %	3,9 %	2,9 %	3,9 %
15-35	3,5 %	2,8 %	3,3 %	3,1 %
36-60	-	3,8 %	3,3 %	3,5 %
61-90	1,8 %	3,9 %	3,0 %	2,7 %
91-180	-	4,1 %	3,2 %	3,4 %
>180	1,4 %	3,5 %	3,3 %	2,7 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,2 %</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**	486	549	3753	3190	11	72	3007	3176	5	61	3141	2849
Intragrupa y off-shore***	0	4	1944	1570	0	0	1371	799	0	0	1247	737
Otros	549	481	477	1415	72	11	582	985	61	5	543	1344
<b>Total</b>	<b>1035</b>	<b>1035</b>	<b>6174</b>	<b>6174</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>4960</b>	<b>4960</b>	<b>66</b>	<b>66</b>	<b>4930</b>	<b>4930</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.