

Fecha de Publicación: 4 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 02 de septiembre 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\$126,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,5%.<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	9,5	17,9	10,0	6,0	6,2	1,7	1,8
15-35	6,7	27,7	22,5	0,0	2,2	3,7	3,0
36-60	57,6	50,7	0,0	0,0	0,7	7,6	50,0
61-90	0,0	1,6	0,0	0,0	1,6	0,0	0,0
91-180	4,0	2,8	0,0	0,0	2,8	4,0	0,0
>180	0,4	2,2	0,0	0,0	2,2	0,4	0,0
<b>Total</b>	<b>78,3</b>	<b>102,9</b>	<b>32,5</b>	<b>6,0</b>	<b>15,6</b>	<b>17,5</b>	<b>54,8</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	0,0 %	3,6 %	-6,3 %	1,2 %
15-35	3,4 %	3,5 %	3,2 %	3,4 %
36-60	0,0 %	4,4 %	3,0 %	0,4 %
61-90	-	3,7 %	-	3,7 %
91-180	-	3,8 %	3,0 %	3,3 %
>180	-	3,8 %	3,1 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>0,2 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>2,1 %</b>	<b>1,5 %</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	2 al 6 de septiembre				9 al 13 de septiembre				16 al 20 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	89	3327	3287	6	61	3265	2904	45	63	2435	2524
Intragrupa y off-shore***	0	1	1438	1004	0	0	1257	752	0	0	1535	654
Otros	89	10	610	1083	61	6	558	1424	63	45	359	1151
<b>Total</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>5375</b>	<b>5375</b>	<b>67</b>	<b>67</b>	<b>5080</b>	<b>5080</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>4329</b>	<b>4329</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.