

Fecha de Publicación: 5 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 03 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\$1812,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.<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	505,3	492,4	249,0	210,0	13,4	65,3	230,0
15-35	509,7	515,7	241,9	124,5	35,2	146,6	238,6
36-60	31,7	43,0	20,0	0,0	23,0	31,7	0,0
61-90	9,9	29,6	0,0	0,0	29,6	9,9	0,0
91-180	51,6	26,6	10,0	0,0	6,6	41,6	10,0
>180	24,3	58,4	20,0	0,0	31,4	17,4	6,9
<b>Total</b>	<b>1132,5</b>	<b>1165,7</b>	<b>540,9</b>	<b>334,5</b>	<b>139,3</b>	<b>312,4</b>	<b>485,5</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	0,4 %	3,1 %	2,4 %	1,9 %
15-35	2,4 %	3,5 %	3,0 %	3,0 %
36-60	-	3,4 %	3,1 %	3,3 %
61-90	-	3,5 %	3,2 %	3,4 %
91-180	3,2 %	3,5 %	3,1 %	3,2 %
>180	3,3 %	3,3 %	3,0 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>1,4 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>2,6 %</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	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	73	3577	3530	19	66	3502	3153	50	64	2589	2604
Intragrupa y off-shore***	0	1	1620	1187	0	0	1314	779	0	0	1562	654
Otros	73	10	631	1110	66	19	560	1444	64	50	359	1252
<b>Total</b>	<b>84</b>	<b>84</b>	<b>5828</b>	<b>5828</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>5376</b>	<b>5376</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>4510</b>	<b>4510</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.