

Fecha de Publicación: 6 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 04 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\$1203,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.<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	422,4	120,8	49,6	293,0	11,2	69,4	60,0
15-35	315,6	312,4	250,5	78,0	18,5	194,2	43,4
36-60	4,5	43,3	0,0	0,0	43,3	4,5	0,0
61-90	3,0	11,6	0,0	0,0	11,6	3,0	0,0
91-180	12,7	50,3	0,0	5,0	50,3	7,7	0,0
>180	1,0	9,4	5,0	0,0	4,4	1,0	0,0
<b>Total</b>	<b>759,2</b>	<b>547,9</b>	<b>305,1</b>	<b>376,0</b>	<b>139,4</b>	<b>279,8</b>	<b>103,4</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	2,7 %	4,0 %	1,1 %	1,7 %
15-35	3,4 %	3,3 %	3,1 %	3,2 %
36-60	-	3,4 %	3,1 %	3,4 %
61-90	-	3,6 %	3,0 %	3,5 %
91-180	-	3,5 %	3,1 %	3,4 %
>180	-	3,5 %	2,8 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>2,2 %</b>	<b>2,8 %</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	75	3801	3613	19	66	3637	3183	50	64	2693	2625		
Intragrupa y off-shore***	0	1	1645	1345	0	0	1339	901	0	0	1580	667		
Otros	75	10	630	1117	66	19	565	1456	64	50	362	1344		
<b>Total</b>	<b>87</b>	<b>87</b>	<b>6075</b>	<b>6075</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>5541</b>	<b>5541</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>4635</b>	<b>4635</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.