

**Fecha de Publicación: 24 de agosto de 2013**

**Fecha de Información: 22 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\$1460,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	283,4	174,1	59,0	34,0	9,1	143,4	106,0
15-35	484,3	575,4	480,3	35,0	23,2	377,3	72,0
36-60	13,6	7,6	0,0	0,0	7,6	13,6	0,0
61-90	37,3	36,7	0,0	0,0	6,7	7,3	30,0
91-180	17,5	25,4	0,0	0,0	10,4	2,5	15,0
>180	10,0	17,9	10,0	1,5	7,9	8,5	0,0
<b>Total</b>	<b>846,0</b>	<b>837,1</b>	<b>549,3</b>	<b>70,5</b>	<b>64,9</b>	<b>552,5</b>	<b>223,0</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	
3-14	2,0 %	2,9 %	3,2 %	2,8 %
15-35	1,7 %	3,4 %	3,7 %	3,4 %
36-60	-	4,0 %	3,6 %	3,7 %
61-90	3,8 %	4,0 %	3,6 %	3,8 %
91-180	3,5 %	3,6 %	3,3 %	3,5 %
>180	-	3,6 %	3,0 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>2,2 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,6 %</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**

Sectores	19 al 23 de agosto				26 al 30 de agosto				2 al 6 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	17	117	3480	3247	30	102	2753	2629	11	73	2347	2604
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2056	1244	0	0	1660	934	0	0	1247	601
<b>Otros</b>	117	17	292	1339	102	30	435	1284	73	11	534	922
<b>Total</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>5829</b>	<b>5829</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>4848</b>	<b>4848</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>4128</b>	<b>4128</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.