

**Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2013**

**Fecha de Información: 06 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\$1658,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	554,6	380,2	160,5	187,5	15,7	163,1	204,0
15-35	274,9	439,7	244,0	51,0	64,7	92,9	131,0
36-60	108,9	53,9	50,0	101,5	3,9	7,4	0,0
61-90	46,9	19,7	0,0	0,0	6,7	33,9	13,0
91-180	33,4	24,2	0,0	0,0	21,2	30,4	3,0
>180	21,7	70,8	10,0	0,0	40,8	1,7	20,0
<b>Total</b>	<b>1040,5</b>	<b>988,5</b>	<b>464,5</b>	<b>340,0</b>	<b>153,0</b>	<b>329,5</b>	<b>371,0</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	3,0 %	3,2 %	2,9 %	3,0 %
15-35	2,9 %	3,1 %	2,4 %	2,9 %
36-60	-	3,3 %	3,2 %	3,2 %
61-90	0,0 %	3,5 %	3,1 %	2,4 %
91-180	4,2 %	2,8 %	3,2 %	3,1 %
>180	0,0 %	3,3 %	2,6 %	2,4 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>2,9 %</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**	3	73	3841	3659	25	64	4067	3651	51	66	2911	2811
Intragruo y off-shore***	0	1	1684	1353	0	0	1554	968	0	0	1625	804
Otros	73	2	637	1148	64	25	613	1615	66	51	442	1364
<b>Total</b>	<b>76</b>	<b>76</b>	<b>6161</b>	<b>6161</b>	<b>88</b>	<b>88</b>	<b>6234</b>	<b>6234</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>4979</b>	<b>4979</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 intragruo.