

**Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2013**

**Fecha de Información: 09 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\$1764,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.<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	438,7	180,4	142,7	273,5	7,7	135,2	30,0
15-35	468,0	329,2	179,2	309,0	87,0	96,0	63,0
36-60	102,4	139,6	110,0	0,0	8,5	81,3	21,2
61-90	27,7	42,2	0,0	0,0	42,2	27,7	0,0
91-180	75,3	126,1	42,0	0,0	9,1	0,3	75,0
>180	1,1	22,9	20,0	0,0	2,9	1,1	0,0
<b>Total</b>	<b>1113,3</b>	<b>840,5</b>	<b>493,9</b>	<b>582,5</b>	<b>157,5</b>	<b>341,7</b>	<b>189,2</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	3,2 %	2,1 %	2,6 %	2,5 %
15-35	3,4 %	3,4 %	3,0 %	3,2 %
36-60	3,3 %	3,3 %	2,9 %	3,2 %
61-90	-	3,8 %	3,2 %	3,6 %
91-180	3,5 %	3,3 %	2,5 %	3,4 %
>180	-	3,3 %	2,9 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>3,0 %</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	9 al 13 de septiembre				16 al 20 de septiembre				23 al 27 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	70	4307	3764	51	70	3084	2871	25	77	2376	2680
Intragruo y off-shore***	0	0	1657	1201	0	0	1665	845	0	0	1641	781
Otros	70	25	614	1612	70	51	442	1476	77	25	555	1111
<b>Total</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>6578</b>	<b>6578</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>5192</b>	<b>5192</b>	<b>102</b>	<b>102</b>	<b>4572</b>	<b>4572</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.