

Fecha de Publicación: 5 de julio de 2013

Fecha de Información: 03 de julio 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\$911,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.<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	135,6	94,8	65,0	0,0	12,8	118,6	17,0
15-35	149,5	524,3	382,0	67,0	96,3	36,5	46,0
36-60	1,2	11,3	0,0	0,0	11,3	1,2	0,0
61-90	6,4	1,8	0,0	0,0	1,8	6,4	0,0
91-180	6,1	32,7	15,0	0,0	17,7	6,1	0,0
>180	8,5	1,9	0,0	0,0	1,9	8,5	0,0
<b>Total</b>	<b>307,2</b>	<b>666,8</b>	<b>462,0</b>	<b>67,0</b>	<b>141,8</b>	<b>177,2</b>	<b>63,0</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	Compras	Ventas	
3-14	4,1 %	3,9 %	3,4 %	3,6 %
15-35	4,9 %	3,8 %	3,9 %	3,9 %
36-60	-	4,2 %	3,3 %	4,1 %
61-90	-	4,6 %	3,6 %	3,8 %
91-180	-	3,8 %	3,3 %	3,7 %
>180	-	3,8 %	2,9 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>4,8 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,8 %</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**

Sectores	1 al 5 de julio				8 al 12 de julio				15 al 19 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	43	2892	3124	102	61	2718	2735	108	137	2307	2643
Intragrupa y off-shore***	0	1	1916	1091	0	0	1785	664	0	0	1667	891
Otros	43	9	394	987	61	102	373	1476	137	108	457	896
<b>Total</b>	<b>54</b>	<b>54</b>	<b>5202</b>	<b>5202</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>4875</b>	<b>4875</b>	<b>245</b>	<b>245</b>	<b>4431</b>	<b>4431</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.