

Fecha de Publicación: 24 de julio de 2013

Fecha de Información: 22 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\$995,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.<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	71,7	159,2	78,3	20,0	44,9	15,7	36,0
15-35	285,3	371,4	347,5	48,0	2,4	215,8	21,5
36-60	2,7	84,4	0,0	0,0	84,4	2,7	0,0
61-90	9,0	12,5	0,0	0,0	12,5	9,0	0,0
91-180	4,7	8,0	0,0	0,0	8,0	4,7	0,0
>180	0,9	43,1	42,0	0,0	1,1	0,9	0,0
<b>Total</b>	<b>374,4</b>	<b>678,6</b>	<b>467,8</b>	<b>68,0</b>	<b>153,3</b>	<b>248,9</b>	<b>57,5</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	0,3 %	4,6 %	4,2 %	3,3 %
15-35	4,1 %	3,9 %	4,1 %	4,0 %
36-60	-	4,0 %	3,2 %	4,0 %
61-90	-	3,9 %	3,9 %	3,9 %
91-180	-	4,8 %	3,6 %	4,4 %
>180	-	3,7 %	3,5 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>1,7 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>4,1 %</b>	<b>3,9 %</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	22 al 26 de julio				29 de jul. al 2 de agosto				5 al 9 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	119	3268	3402	7	63	1923	2501	11	72	2051	2691
Intragrupa y off-shore***	0	0	2041	1222	0	0	1352	548	0	0	1457	607
Otros	119	20	451	1136	63	7	351	577	72	11	461	671
<b>Total</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>5760</b>	<b>5760</b>	<b>70</b>	<b>70</b>	<b>3626</b>	<b>3626</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>3968</b>	<b>3968</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.