

Fecha de Publicación: 25 de julio de 2013

Fecha de Información: 23 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\$962,8 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	195,8	127,8	57,0	13,0	0,8	112,8	70,0
15-35	317,9	423,3	273,0	106,0	6,3	67,9	144,0
36-60	5,6	15,8	0,0	0,0	15,8	5,6	0,0
61-90	5,3	16,3	0,0	0,0	11,3	0,3	5,0
91-180	15,5	10,4	0,0	0,0	10,4	15,5	0,0
>180	16,4	46,7	30,0	0,0	1,7	1,4	15,0
<b>Total</b>	<b>556,5</b>	<b>640,3</b>	<b>360,0</b>	<b>119,0</b>	<b>46,3</b>	<b>203,5</b>	<b>234,0</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	3,0 %	4,1 %	3,5 %	3,5 %
15-35	3,4 %	4,5 %	4,4 %	4,1 %
36-60	-	4,4 %	4,0 %	4,3 %
61-90	3,9 %	4,1 %	3,0 %	4,0 %
91-180	-	4,8 %	3,7 %	4,2 %
>180	3,9 %	3,9 %	3,4 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</b>	<b>4,4 %</b>	<b>4,0 %</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**

Sector	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	117	3303	3467	7	65	2078	2559	11	72	2063	2696
Intragrupa y off-shore***	0	0	2086	1222	0	0	1364	561	0	0	1457	607
Otros	117	20	451	1151	65	7	352	675	72	11	461	678
<b>Total</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>5840</b>	<b>5840</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>3795</b>	<b>3795</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>3981</b>	<b>3981</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.