

**Fecha de Publicación: 23 de julio de 2013**

**Fecha de Información: 19 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\$1082,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	360,8	198,7	57,5	142,5	6,2	83,3	135,0
15-35	242,3	442,0	280,0	73,0	79,5	86,8	82,5
36-60	22,7	2,2	0,0	0,0	2,2	22,7	0,0
61-90	7,0	9,4	0,0	0,0	9,4	7,0	0,0
91-180	0,1	14,0	0,0	0,0	14,0	0,1	0,0
>180	0,4	0,8	0,0	0,0	0,8	0,4	0,0
<b>Total</b>	<b>633,2</b>	<b>667,1</b>	<b>337,5</b>	<b>215,5</b>	<b>112,1</b>	<b>200,2</b>	<b>217,5</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	
3-14	1,9 %	2,5 %	2,8 %	2,4 %
15-35	3,9 %	4,0 %	3,7 %	3,9 %
36-60	-	4,8 %	3,7 %	3,8 %
61-90	-	4,1 %	3,8 %	4,0 %
91-180	-	4,0 %	3,1 %	4,0 %
>180	-	4,3 %	3,6 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,3 %</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	15 al 19 de julio				22 al 26 de julio				29 de jul. al 2 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	102	139	3692	3389	19	116	3217	3316	5	63	1907	2446
Intragrupo y off-shore***	0	0	2022	1500	0	0	1963	1202	0	0	1352	548
Otros	139	102	535	1361	116	19	464	1126	63	5	312	576
<b>Total</b>	<b>240</b>	<b>240</b>	<b>6250</b>	<b>6250</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>5644</b>	<b>5644</b>	<b>69</b>	<b>69</b>	<b>3570</b>	<b>3570</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.