

**Fecha de Publicación: 26 de julio de 2013**

**Fecha de Información: 24 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\$1240,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.<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	520,7	281,8	151,0	89,5	4,8	305,2	126,0
15-35	285,4	215,1	198,0	67,5	9,1	209,9	8,0
36-60	3,8	8,5	0,0	0,0	8,5	3,8	0,0
61-90	3,1	7,4	0,0	0,0	7,4	3,1	0,0
91-180	30,5	15,3	5,0	0,0	10,3	30,5	0,0
>180	1,0	1,7	0,0	0,0	1,7	1,0	0,0
<b>Total</b>	<b>844,5</b>	<b>529,8</b>	<b>354,0</b>	<b>157,0</b>	<b>41,8</b>	<b>553,5</b>	<b>134,0</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	
3-14	4,6 %	2,7 %	3,7 %	3,7 %
15-35	4,8 %	4,6 %	4,3 %	4,4 %
36-60	-	4,6 %	3,7 %	4,3 %
61-90	-	4,5 %	3,8 %	4,3 %
91-180	-	4,5 %	4,0 %	4,1 %
>180	-	5,3 %	3,6 %	4,6 %
<b>Total</b>	<b>4,7 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>4,0 %</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	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	114	3312	3499	8	65	2521	2808	11	72	2173	2699
Intragrupo y off-shore***	0	0	2114	1227	0	0	1488	620	0	0	1457	632
Otros	114	20	455	1154	65	8	352	932	72	11	464	763
<b>Total</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>5881</b>	<b>5881</b>	<b>73</b>	<b>73</b>	<b>4361</b>	<b>4361</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>4094</b>	<b>4094</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.