

Fecha de Publicación: 8 de abril de 2013

Fecha de Información: 04 de abril 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\$2195,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	361,4	366,4	256,5	175,6	54,9	130,8	55,0
15-35	609,0	730,1	612,0	186,0	81,1	386,0	37,0
36-60	15,1	20,6	19,0	0,0	1,6	15,1	0,0
61-90	9,6	98,4	85,0	0,0	13,4	9,6	0,0
91-180	5,8	9,8	0,0	0,0	9,8	5,8	0,0
>180	19,6	46,2	30,0	0,0	11,2	14,6	5,0
<b>Total</b>	<b>1020,6</b>	<b>1271,5</b>	<b>1002,5</b>	<b>361,6</b>	<b>172,0</b>	<b>561,9</b>	<b>97,0</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	3,4 %	3,7 %	3,1 %	3,3 %
15-35	4,2 %	3,7 %	3,2 %	3,4 %
36-60	-	3,5 %	3,1 %	3,3 %
61-90	-	3,2 %	3,8 %	3,3 %
91-180	-	3,1 %	2,3 %	2,8 %
>180	3,6 %	3,1 %	2,8 %	3,1 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,4 %</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 abril				8 al 12 de abril				15 al 19 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	100	4005	3279	29	142	2606	2732	14	113	1990	2727
Intragrupa y off-shore***	0	0	1872	1160	0	1	1734	772	0	0	1938	784
Otros	100	13	651	2089	142	28	633	1468	113	14	440	857
<b>Total</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>6528</b>	<b>6528</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>4972</b>	<b>4972</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>4368</b>	<b>4368</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.