

Fecha de Publicación: 16 de abril de 2013

Fecha de Información: 12 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\$928,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.<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	229,8	378,8	207,3	66,8	106,6	98,1	65,0
15-35	183,0	131,3	87,3	116,0	16,0	39,0	28,0
36-60	24,1	22,1	0,4	0,0	21,8	24,1	0,0
61-90	8,7	10,6	5,0	0,0	5,6	8,7	0,0
91-180	1,5	21,1	5,0	0,0	16,1	1,5	0,0
>180	7,0	3,5	0,0	0,0	3,5	7,0	0,0
<b>Total</b>	<b>454,2</b>	<b>567,5</b>	<b>304,9</b>	<b>182,8</b>	<b>169,7</b>	<b>178,4</b>	<b>93,0</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	1,9 %	3,0 %	2,6 %	2,6 %
15-35	2,7 %	2,8 %	2,8 %	2,8 %
36-60	-	3,5 %	3,0 %	3,2 %
61-90	-	3,1 %	2,7 %	2,9 %
91-180	-	3,0 %	2,8 %	2,9 %
>180	-	3,4 %	2,7 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>2,1 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>2,7 %</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	8 al 12 de abril				15 al 19 de abril				22 al 26 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	115	3552	3173	18	122	2756	3412	19	107	2048	2740
Intragrupa y off-shore***	0	1	1958	1498	0	0	2285	825	0	0	1908	555
Otros	115	32	743	1581	122	18	630	1434	107	19	536	1197
<b>Total</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>6253</b>	<b>6253</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>5671</b>	<b>5671</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>4492</b>	<b>4492</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.