

Fecha de Publicación: 23 de abril de 2013

Fecha de Información: 19 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\$1416,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.<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	202,3	146,7	5,0	101,0	81,7	41,3	60,0
15-35	525,9	353,1	259,0	313,5	32,1	150,4	62,0
36-60	11,3	18,3	0,6	0,0	17,8	11,3	0,0
61-90	38,0	91,9	10,0	0,0	49,9	6,0	32,0
91-180	0,3	26,0	20,2	0,0	5,9	0,3	0,0
>180	29,6	132,4	110,0	0,8	17,4	23,8	5,0
<b>Total</b>	<b>807,3</b>	<b>768,4</b>	<b>404,7</b>	<b>415,3</b>	<b>204,7</b>	<b>233,1</b>	<b>159,0</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 %	3,5 %	2,5 %	3,0 %
15-35	3,2 %	3,3 %	3,2 %	3,2 %
36-60	-	3,5 %	2,7 %	3,2 %
61-90	3,2 %	3,3 %	3,0 %	3,2 %
91-180	-	3,2 %	2,0 %	3,2 %
>180	0,0 %	3,1 %	2,9 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,1 %</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	15 al 19 de abril				22 al 26 de abril				29 de abr. al 3 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	117	3662	3494	23	115	2788	3378	8	66	2262	2092
Intragrupa y off-shore***	0	0	2310	1613	0	0	2226	844	0	0	1153	787
Otros	117	20	632	1498	115	23	751	1543	66	8	525	1060
<b>Total</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>6605</b>	<b>6605</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>5765</b>	<b>5765</b>	<b>74</b>	<b>74</b>	<b>3939</b>	<b>3939</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.