

Fecha de Publicación: 30 de abril de 2013

Fecha de Información: 26 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\$1302,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.<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	236,2	209,6	99,7	115,8	54,9	65,5	55,0
15-35	438,7	432,9	287,0	98,5	76,9	271,2	69,0
36-60	0,8	3,9	0,0	0,0	3,9	0,8	0,0
61-90	1,0	19,9	0,0	0,0	19,9	1,0	0,0
91-180	22,4	13,5	4,5	1,5	8,4	20,4	0,6
>180	30,8	43,3	16,0	0,6	1,9	4,8	25,4
<b>Total</b>	<b>729,9</b>	<b>722,9</b>	<b>407,2</b>	<b>216,3</b>	<b>165,8</b>	<b>363,7</b>	<b>150,0</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	2,0 %	2,9 %	2,5 %	2,6 %
15-35	3,1 %	3,2 %	2,9 %	3,0 %
36-60	-	3,8 %	2,0 %	3,5 %
61-90	-	3,2 %	2,3 %	3,2 %
91-180	2,9 %	4,4 %	3,0 %	3,5 %
>180	1,9 %	3,2 %	2,8 %	2,3 %
<b>Total</b>	<b>2,5 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>2,9 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	22 al 26 de abril				29 de abr. al 3 de mayo				6 al 10 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	22	113	3583	3668	10	69	2747	2547	9	75	3147	3567
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2369	1481	0	0	1423	949	0	0	2535	1078
<b>Otros</b>	113	22	790	1593	69	10	614	1288	75	9	556	1592
<b>Total</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>6743</b>	<b>6743</b>	<b>79</b>	<b>79</b>	<b>4784</b>	<b>4784</b>	<b>84</b>	<b>84</b>	<b>6237</b>	<b>6237</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.