

Fecha de Publicación: 9 de mayo de 2013

Fecha de Información: 07 de mayo 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\$1835,8 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	359,7	192,6	103,0	135,0	59,6	194,7	30,0
15-35	376,4	486,9	375,5	82,5	35,4	217,9	76,0
36-60	57,7	44,5	8,0	0,0	36,5	57,7	0,0
61-90	0,2	14,0	0,0	0,0	14,0	0,2	0,0
91-180	160,5	150,0	121,2	149,9	23,8	5,6	5,0
>180	51,3	57,9	30,0	44,8	22,9	1,5	5,0
<b>Total</b>	<b>1005,9</b>	<b>945,9</b>	<b>637,7</b>	<b>412,2</b>	<b>192,3</b>	<b>477,7</b>	<b>116,0</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	3,3 %	3,7 %	2,7 %	3,0 %
15-35	3,0 %	3,2 %	3,0 %	3,1 %
36-60	-	3,4 %	2,7 %	3,0 %
61-90	-	3,4 %	2,8 %	3,4 %
91-180	3,3 %	3,3 %	3,3 %	3,3 %
>180	3,3 %	3,3 %	3,3 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>2,8 %</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	6 al 10 de mayo				13 al 17 de mayo				20 al 24 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	84	4165	4339	20	103	2238	2686	13	117	3606	2915
Intragrupa y off-shore***	0	1	2763	1474	0	0	1721	567	0	0	1760	1521
Otros	84	24	792	1907	103	20	463	1168	117	13	443	1373
<b>Total</b>	<b>109</b>	<b>109</b>	<b>7720</b>	<b>7720</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>4422</b>	<b>4422</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>5809</b>	<b>5809</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.