

Fecha de Publicación: 10 de mayo de 2013

Fecha de Información: 08 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\$1643,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.<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	470,5	364,6	152,0	231,0	52,6	79,5	160,0
15-35	249,2	421,6	341,8	50,3	42,9	162,0	37,0
36-60	69,1	46,7	0,0	0,0	46,7	69,1	0,0
61-90	0,9	0,6	0,0	0,0	0,6	0,9	0,0
91-180	69,0	4,9	0,7	64,7	4,2	4,4	0,0
>180	94,1	59,5	45,0	60,8	4,5	23,2	10,0
<b>Total</b>	<b>952,8</b>	<b>897,9</b>	<b>539,4</b>	<b>406,8</b>	<b>151,5</b>	<b>339,1</b>	<b>207,0</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 %	2,3 %	2,3 %	2,2 %
15-35	3,3 %	3,4 %	3,1 %	3,3 %
36-60	-	3,6 %	2,9 %	3,2 %
61-90	-	4,2 %	3,2 %	3,6 %
91-180	-	3,9 %	3,1 %	3,5 %
>180	3,4 %	3,4 %	3,2 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>2,3 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>2,8 %</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	82	4360	4418	21	103	2399	2927	13	117	3744	3055
Intragrupa y off-shore***	0	1	2825	1628	0	0	1791	567	0	0	1867	1618
Otros	82	24	789	1927	103	21	514	1210	117	13	453	1391
<b>Total</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>7974</b>	<b>7974</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>4704</b>	<b>4704</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>6065</b>	<b>6065</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.