

Fecha de Publicación: 15 de mayo de 2013

Fecha de Información: 10 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\$1277,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	184,2	267,1	71,7	60,5	130,4	58,7	65,0
15-35	317,4	542,0	418,4	56,0	44,6	182,4	79,0
36-60	52,7	32,0	0,0	19,8	7,0	7,9	25,0
61-90	26,3	4,5	0,0	25,2	4,5	1,1	0,0
91-180	7,8	11,2	0,0	0,0	11,2	7,8	0,0
>180	0,1	0,8	0,0	0,0	0,8	0,1	0,0
<b>Total</b>	<b>588,7</b>	<b>857,6</b>	<b>490,1</b>	<b>161,6</b>	<b>198,6</b>	<b>258,1</b>	<b>169,0</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	3,2 %	3,4 %	2,1 %	3,0 %
15-35	2,7 %	3,8 %	3,2 %	3,4 %
36-60	3,6 %	3,7 %	3,2 %	3,5 %
61-90	-	3,6 %	4,1 %	3,7 %
91-180	-	3,7 %	3,0 %	3,4 %
>180	-	3,9 %	3,1 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,3 %</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**

Sectores	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	86	4463	4485	23	109	2684	3320	15	116	3958	3243
Intragrupa y off-shore***	0	1	2880	1725	0	0	1914	693	0	0	1962	1618
Otros	86	24	786	1919	109	23	704	1288	116	15	510	1569
<b>Total</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>8129</b>	<b>8129</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>5301</b>	<b>5301</b>	<b>131</b>	<b>131</b>	<b>6430</b>	<b>6430</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.