

Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2013

Fecha de Información: 14 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\$1398,9 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	368,7	346,1	235,0	258,5	87,1	86,2	24,0
15-35	246,2	347,3	316,4	66,0	19,9	169,2	11,0
36-60	20,3	3,1	0,0	0,0	3,1	20,3	0,0
61-90	3,0	9,8	0,0	0,0	9,8	3,0	0,0
91-180	11,6	9,8	0,0	0,0	9,8	11,6	0,0
>180	23,1	45,0	45,0	0,0	0,0	23,1	0,0
<b>Total</b>	<b>672,9</b>	<b>761,0</b>	<b>596,4</b>	<b>324,5</b>	<b>129,6</b>	<b>313,4</b>	<b>35,0</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	3,5 %	3,0 %	1,4 %	2,2 %
15-35	3,7 %	3,5 %	3,2 %	3,3 %
36-60	-	3,7 %	3,1 %	3,2 %
61-90	-	3,8 %	3,1 %	3,7 %
91-180	-	3,4 %	3,2 %	3,3 %
>180	-	3,4 %	3,2 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,3 %</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	13 al 17 de mayo				20 al 24 de mayo				27 al 31 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	107	3010	3425	15	120	3999	3479	9	63	1617	1627
Intragrupa y off-shore***	0	0	1997	926	0	0	2113	1643	0	0	1013	535
Otros	107	23	705	1361	120	15	591	1580	63	9	341	809
<b>Total</b>	<b>131</b>	<b>131</b>	<b>5712</b>	<b>5712</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>6703</b>	<b>6703</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>2972</b>	<b>2972</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.