

Fecha de Publicación: 17 de mayo de 2013

Fecha de Información: 15 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\$1742,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.<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	408,3	259,6	161,7	269,7	36,9	77,6	61,0
15-35	278,2	479,4	424,6	46,7	12,8	189,5	42,0
36-60	213,1	65,6	40,0	95,0	25,6	118,1	0,0
61-90	5,6	22,8	0,0	0,0	22,8	5,6	0,0
91-180	45,0	4,6	0,0	0,0	4,6	45,0	0,0
>180	51,9	10,9	0,0	0,0	10,9	51,9	0,0
<b>Total</b>	<b>1002,2</b>	<b>842,8</b>	<b>626,3</b>	<b>411,4</b>	<b>113,5</b>	<b>487,8</b>	<b>103,0</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	3,7 %	3,1 %	2,7 %	3,0 %
15-35	3,6 %	3,6 %	2,8 %	3,3 %
36-60	-	3,3 %	3,3 %	3,3 %
61-90	-	3,5 %	3,0 %	3,4 %
91-180	-	3,0 %	3,3 %	3,3 %
>180	-	3,0 %	3,0 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,2 %</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	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	109	3257	3453	15	124	4159	3705	9	64	1620	1713
Intragrupa y off-shore***	0	0	2000	1141	0	0	2272	1698	0	0	1098	535
Otros	109	23	705	1367	124	15	623	1651	64	9	342	812
<b>Total</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>5962</b>	<b>5962</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>7054</b>	<b>7054</b>	<b>73</b>	<b>73</b>	<b>3060</b>	<b>3060</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.