

Fecha de Publicación: 23 de mayo de 2013

Fecha de Información: 21 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\$1406,3 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	273,6	370,6	95,0	68,0	93,6	23,6	182,0
15-35	554,4	314,9	181,8	131,0	15,1	305,4	118,0
36-60	6,7	5,5	0,0	0,0	0,5	1,7	5,0
61-90	0,6	1,3	0,0	0,0	1,3	0,6	0,0
91-180	22,9	28,7	0,0	0,0	8,7	2,9	20,0
>180	104,1	83,0	40,0	24,5	8,0	44,6	35,0
<b>Total</b>	<b>962,4</b>	<b>803,9</b>	<b>316,8</b>	<b>223,5</b>	<b>127,2</b>	<b>378,9</b>	<b>360,0</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 %	3,1 %	1,8 %	3,0 %
15-35	3,5 %	3,8 %	3,4 %	3,5 %
36-60	3,6 %	3,8 %	3,0 %	3,5 %
61-90	-	3,8 %	2,8 %	3,5 %
91-180	3,6 %	3,8 %	3,2 %	3,6 %
>180	3,5 %	3,5 %	3,4 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,1 %</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**

Sector	20 al 24 de mayo				27 al 31 de mayo				3 al 7 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	115	4837	4688	9	71	1803	2135	3	68	2083	2488
Intragrupa y off-shore***	0	0	2558	1850	0	0	1313	535	0	0	1611	537
Otros	115	15	843	1700	71	9	459	904	68	3	357	1026
<b>Total</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>8238</b>	<b>8238</b>	<b>81</b>	<b>81</b>	<b>3574</b>	<b>3574</b>	<b>71</b>	<b>71</b>	<b>4051</b>	<b>4051</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.