

Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2013

Fecha de Información: 22 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\$1502,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.<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	231,5	81,0	104,8	116,5	45,4	34,0
15-35	577,8	302,4	193,0	296,2	6,4	178,6	103,0
36-60	65,6	4,9	0,0	0,0	4,9	65,6	0,0
61-90	55,4	49,9	0,0	0,0	4,9	10,4	45,0
91-180	80,4	103,4	45,0	24,4	8,4	6,0	50,0
>180	38,2	40,6	40,0	0,0	0,6	38,2	0,0
<b>Total</b>	<b>1001,6</b>	<b>732,8</b>	<b>359,0</b>	<b>425,4</b>	<b>141,8</b>	<b>344,2</b>	<b>232,0</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 %	4,0 %	2,3 %	3,4 %
15-35	3,4 %	3,8 %	3,5 %	3,5 %
36-60	-	3,6 %	3,1 %	3,2 %
61-90	3,6 %	3,6 %	3,4 %	3,6 %
91-180	3,7 %	3,8 %	3,5 %	3,7 %
>180	-	3,6 %	3,2 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,5 %</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	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**	16	120	4954	4741	10	71	1866	2227	3	68	2188	2590
Intragrupa y off-shore***	0	0	2608	1945	0	0	1344	545	0	0	1611	537
Otros	120	16	826	1701	71	10	506	944	68	3	428	1101
<b>Total</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>8388</b>	<b>8388</b>	<b>81</b>	<b>81</b>	<b>3716</b>	<b>3716</b>	<b>71</b>	<b>71</b>	<b>4228</b>	<b>4228</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.