

Fecha de Publicación: 30 de mayo de 2013

Fecha de Información: 28 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\$2345,3 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	558,6	547,6	355,3	451,1	113,0	28,2	79,3
15-35	408,4	471,9	390,8	241,8	31,2	116,6	50,0
36-60	58,4	88,2	35,0	8,5	49,2	45,9	4,0
61-90	63,2	34,0	0,0	3,4	31,0	56,8	3,0
91-180	92,4	51,5	15,0	5,0	6,5	57,4	30,0
>180	100,9	42,5	26,5	0,0	10,0	94,9	6,0
<b>Total</b>	<b>1281,9</b>	<b>1235,7</b>	<b>822,6</b>	<b>709,7</b>	<b>240,9</b>	<b>399,9</b>	<b>172,3</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	2,9 %	2,1 %	1,3 %	1,8 %
15-35	3,5 %	4,0 %	3,3 %	3,6 %
36-60	3,4 %	3,7 %	3,3 %	3,5 %
61-90	3,3 %	3,9 %	3,3 %	3,5 %
91-180	3,5 %	3,8 %	3,4 %	3,4 %
>180	3,7 %	3,7 %	3,1 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,5 %</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**

Sectores	27 al 31 de mayo				3 al 7 de junio				10 al 14 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	78	2396	2575	4	70	2682	3207	16	110	1854	2362
Intragrupa y off-shore***	0	0	1451	844	0	0	1946	809	0	0	1539	463
Otros	78	10	604	1032	70	4	599	1211	110	16	429	998
<b>Total</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>4452</b>	<b>4452</b>	<b>74</b>	<b>74</b>	<b>5227</b>	<b>5227</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>3823</b>	<b>3823</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.