

Fecha de Publicación: 5 de junio de 2013

Fecha de Información: 31 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\$1202,5 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	97,3	63,5	21,0	71,5	42,5	25,8	0,0
15-35	453,0	596,7	322,5	190,0	86,2	75,0	188,0
36-60	13,8	3,2	0,0	0,0	3,2	13,8	0,0
61-90	23,8	9,9	0,0	0,0	9,9	23,8	0,0
91-180	18,4	22,7	10,0	0,0	12,7	18,4	0,0
>180	50,6	47,6	36,0	0,0	1,6	40,6	10,0
<b>Total</b>	<b>656,9</b>	<b>743,6</b>	<b>389,5</b>	<b>261,5</b>	<b>156,1</b>	<b>197,4</b>	<b>198,0</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 %	2,0 %	2,6 %
15-35	3,3 %	3,6 %	3,0 %	3,4 %
36-60	-	4,1 %	2,7 %	2,9 %
61-90	-	3,7 %	3,1 %	3,3 %
91-180	-	3,7 %	3,0 %	3,4 %
>180	3,3 %	3,4 %	3,1 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>2,7 %</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	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	80	2689	2685	6	73	2863	3346	20	115	2031	2599
Intragrupa y off-shore***	0	0	1496	1061	0	1	2053	929	0	0	1637	476
Otros	80	10	610	1049	73	5	630	1272	115	20	513	1106
<b>Total</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>4795</b>	<b>4795</b>	<b>79</b>	<b>79</b>	<b>5547</b>	<b>5547</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>4181</b>	<b>4181</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.