

Fecha de Publicación: 17 de junio de 2013

Fecha de Información: 13 de junio 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\$1770,6 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	489,2	172,6	50,0	209,0	14,5	172,1	108,1
15-35	353,4	583,6	458,8	187,8	40,8	81,6	84,0
36-60	86,7	27,1	0,0	0,0	27,1	86,7	0,0
61-90	7,2	13,1	0,0	0,0	13,1	7,2	0,0
91-180	61,0	142,4	81,7	0,0	20,6	21,0	40,0
>180	40,8	40,7	12,2	10,0	13,5	15,8	15,0
<b>Total</b>	<b>1038,3</b>	<b>979,4</b>	<b>602,7</b>	<b>406,8</b>	<b>129,6</b>	<b>384,4</b>	<b>247,1</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	3,1 %	3,5 %	3,7 %	3,6 %
15-35	2,0 %	3,4 %	3,2 %	3,2 %
36-60	-	3,5 %	2,9 %	3,1 %
61-90	-	3,4 %	3,3 %	3,3 %
91-180	2,6 %	3,5 %	3,2 %	3,2 %
>180	3,4 %	3,3 %	3,2 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,4 %</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	10 al 14 de junio				17 al 21 de junio				24 al 28 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	125	3273	3118	17	81	3599	3444	31	98	2748	2330
Intragrupa y off-shore***	0	0	1815	1229	0	0	2093	1092	0	0	1495	1369
Otros	125	30	592	1333	81	17	488	1644	98	31	470	1015
<b>Total</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>5680</b>	<b>5680</b>	<b>97</b>	<b>97</b>	<b>6179</b>	<b>6179</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>4713</b>	<b>4713</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.