

Fecha de Publicación: 25 de junio de 2013

Fecha de Información: 21 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\$1582,3 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	509,6	333,8	240,0	201,0	24,8	239,6	69,0
15-35	273,2	403,7	251,0	116,0	76,7	81,2	76,0
36-60	12,2	3,3	0,0	0,0	3,3	12,2	0,0
61-90	7,1	22,4	20,0	0,0	2,4	7,1	0,0
91-180	20,5	28,7	25,0	0,0	3,7	20,5	0,0
>180	84,5	28,3	20,0	55,3	8,3	29,1	0,0
<b>Total</b>	<b>907,0</b>	<b>820,2</b>	<b>556,0</b>	<b>372,3</b>	<b>119,2</b>	<b>389,7</b>	<b>145,0</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 %	3,5 %	2,7 %	3,0 %
15-35	3,7 %	3,4 %	3,4 %	3,4 %
36-60	-	4,0 %	3,1 %	3,3 %
61-90	-	3,9 %	3,2 %	3,8 %
91-180	-	4,0 %	3,3 %	3,4 %
>180	-	3,9 %	3,4 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>2,9 %</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	17 al 21 de junio				24 al 28 de junio				1 al 5 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	85	4588	3901	34	122	3993	3022	5	37	1869	2613
Intragrupa y off-shore***	0	0	2254	1543	0	0	1704	1682	0	0	1726	674
Otros	85	20	508	1906	122	34	654	1646	37	5	332	640
<b>Total</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>7349</b>	<b>7349</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>6351</b>	<b>6351</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>3927</b>	<b>3927</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.