

Fecha de Publicación: 27 de junio de 2013

Fecha de Información: 25 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\$1877,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	429,9	96,6	28,5	194,5	15,1	182,4	53,0
15-35	731,8	466,5	245,7	302,1	25,8	234,8	195,0
36-60	86,1	63,6	0,0	0,0	33,6	56,1	30,0
61-90	8,6	22,2	0,0	0,0	22,2	8,6	0,0
91-180	76,6	110,3	60,0	0,0	15,3	41,6	35,0
>180	18,9	89,1	29,0	0,0	50,1	8,9	10,0
<b>Total</b>	<b>1352,0</b>	<b>848,3</b>	<b>363,2</b>	<b>496,6</b>	<b>162,1</b>	<b>532,5</b>	<b>323,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,1 %	2,9 %	3,2 %	3,2 %
15-35	3,5 %	3,3 %	3,1 %	3,2 %
36-60	3,4 %	3,8 %	3,1 %	3,4 %
61-90	-	3,5 %	3,4 %	3,5 %
91-180	3,0 %	3,2 %	3,4 %	3,2 %
>180	3,5 %	3,5 %	3,4 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,2 %</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**

Sector	24 al 28 de junio				1 al 5 de julio				8 al 12 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	129	4334	3187	6	41	2012	2646	100	56	2094	2353
Intragruppo y off-shore***	0	0	1805	1843	0	0	1726	677	0	0	1620	628
Otros	129	34	679	1789	41	6	330	745	56	100	346	1079
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>6818</b>	<b>6818</b>	<b>47</b>	<b>47</b>	<b>4068</b>	<b>4068</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>4060</b>	<b>4060</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 intragruppo.