

Fecha de Publicación: 17 de enero de 2013

Fecha de Información: 15 de enero 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\$1758,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.<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	322,2	72,7	47,8	66,0	5,0	236,2	20,0
15-35	513,1	513,2	375,3	293,1	50,9	133,1	87,0
36-60	28,2	265,5	190,0	0,0	65,5	18,2	10,0
61-90	29,2	45,5	16,0	15,0	29,5	14,2	0,0
91-180	6,4	3,6	0,0	0,0	3,6	6,4	0,0
>180	40,4	45,7	35,0	0,0	0,7	30,4	10,0
<b>Total</b>	<b>939,6</b>	<b>946,2</b>	<b>664,0</b>	<b>374,1</b>	<b>155,2</b>	<b>438,5</b>	<b>127,0</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	0,9 %	1,4 %	1,9 %	1,8 %
15-35	3,1 %	3,4 %	2,4 %	2,9 %
36-60	1,7 %	2,9 %	2,8 %	2,8 %
61-90	-	3,1 %	3,1 %	3,1 %
91-180	-	3,7 %	2,7 %	3,1 %
>180	3,3 %	3,4 %	3,2 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,3 %</b>	<b>2,7 %</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	14 al 18 de enero				21 al 25 de enero				28 de ene. al 1 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	84	3070	2924	10	133	2078	2161	4	60	1543	2108
Intragrupa y off-shore***	0	0	1639	893	0	0	1212	572	0	0	1223	472
Otros	84	30	596	1488	133	10	476	1033	60	4	502	688
<b>Total</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>5304</b>	<b>5304</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>3766</b>	<b>3766</b>	<b>63</b>	<b>63</b>	<b>3268</b>	<b>3268</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.