

Fecha de Publicación: 18 de enero de 2013

Fecha de Información: 16 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\$1377,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.<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	297,5	145,4	95,3	84,3	5,1	168,3	45,0
15-35	200,1	417,9	310,5	57,5	9,4	44,6	98,0
36-60	187,4	111,3	25,5	50,0	75,8	127,4	10,0
61-90	36,7	28,1	0,0	0,0	8,1	16,7	20,0
91-180	9,2	15,0	0,0	0,0	15,0	9,2	0,0
>180	65,8	65,9	5,0	15,0	30,9	20,8	30,0
<b>Total</b>	<b>796,7</b>	<b>783,6</b>	<b>436,3</b>	<b>206,8</b>	<b>144,3</b>	<b>387,0</b>	<b>203,0</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	1,1 %	2,2 %	3,0 %	2,6 %
15-35	3,1 %	3,4 %	2,7 %	3,1 %
36-60	3,5 %	3,7 %	2,9 %	3,2 %
61-90	4,2 %	4,5 %	3,4 %	4,0 %
91-180	-	4,0 %	3,4 %	3,8 %
>180	3,7 %	3,7 %	3,4 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,1 %</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
<b>Sector Financiero**</b>	30	76	3269	3000	11	136	2137	2213	4	61	1584	2135
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1696	941	0	0	1241	597	0	0	1236	483
<b>Otros</b>	76	30	605	1630	136	11	474	1042	61	4	505	708
<b>Total</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>5570</b>	<b>5570</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>3852</b>	<b>3852</b>	<b>65</b>	<b>65</b>	<b>3326</b>	<b>3326</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.