

Fecha de Publicación: 22 de enero de 2013

Fecha de Información: 18 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\$1179,3 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	278,9	56,1	24,0	24,0	3,0	225,8	29,1
15-35	213,4	455,4	355,5	57,0	17,9	74,4	82,0
36-60	77,4	12,3	10,0	10,0	2,3	67,4	0,0
61-90	12,0	13,8	0,0	0,0	13,8	12,0	0,0
91-180	16,7	32,5	5,0	0,0	27,5	16,7	0,0
>180	35,0	101,8	5,0	20,0	81,8	0,0	15,0
<b>Total</b>	<b>633,4</b>	<b>672,0</b>	<b>399,5</b>	<b>111,0</b>	<b>146,4</b>	<b>396,4</b>	<b>126,1</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	4,7 %	4,2 %	3,2 %	3,4 %
15-35	2,9 %	2,8 %	3,5 %	3,0 %
36-60	-	4,2 %	3,4 %	3,5 %
61-90	-	3,8 %	3,5 %	3,7 %
91-180	-	2,2 %	3,4 %	2,6 %
>180	3,6 %	3,7 %	3,2 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,3 %</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	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	79	3448	3033	16	140	2485	2331	6	61	1744	2150
Intragrupa y off-shore***	0	0	1721	1005	0	0	1277	617	0	0	1236	581
Otros	79	30	601	1732	140	16	484	1297	61	6	521	770
<b>Total</b>	<b>109</b>	<b>109</b>	<b>5770</b>	<b>5770</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>4245</b>	<b>4245</b>	<b>67</b>	<b>67</b>	<b>3501</b>	<b>3501</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.