

Fecha de Publicación: 25 de enero de 2013

Fecha de Información: 23 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\$1429,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.<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	446,1	74,7	28,0	210,0	16,7	206,1	30,0
15-35	302,9	441,9	313,2	161,3	75,7	88,6	53,0
36-60	48,8	23,5	5,0	32,4	11,5	9,4	7,0
61-90	10,8	51,9	50,0	10,0	1,9	0,8	0,0
91-180	14,4	15,1	0,0	10,1	15,1	4,3	0,0
>180	62,6	41,5	25,0	0,0	1,5	47,6	15,0
<b>Total</b>	<b>885,8</b>	<b>648,6</b>	<b>421,2</b>	<b>423,8</b>	<b>122,4</b>	<b>357,0</b>	<b>105,0</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	3,3 %	2,0 %	4,6 %	4,4 %
15-35	3,6 %	4,0 %	3,9 %	3,9 %
36-60	3,8 %	4,9 %	2,3 %	3,3 %
61-90	-	2,6 %	3,4 %	2,6 %
91-180	-	3,7 %	3,4 %	3,7 %
>180	3,5 %	3,1 %	3,5 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,0 %</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	21 al 25 de enero				28 de ene. al 1 de febrero				4 al 8 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	149	2973	2413	6	65	2092	2364	2	101	2457	2402
Intragrupa y off-shore***	0	0	1304	900	0	0	1285	611	0	0	1420	1159
Otros	149	17	489	1453	65	6	586	988	101	2	525	840
<b>Total</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>4765</b>	<b>4765</b>	<b>71</b>	<b>71</b>	<b>3962</b>	<b>3962</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>4401</b>	<b>4401</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.