

Fecha de Publicación: 28 de enero de 2013

Fecha de Información: 24 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\$1384,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	277,7	67,0	10,0	44,5	30,0	206,2	27,0
15-35	371,2	459,6	344,5	123,0	30,1	163,2	85,0
36-60	56,7	55,3	0,0	0,0	55,3	56,7	0,0
61-90	19,7	31,5	0,0	0,0	31,5	19,7	0,0
91-180	56,1	11,1	0,0	10,5	11,1	45,6	0,0
>180	72,4	58,3	5,0	11,8	13,3	20,6	40,0
<b>Total</b>	<b>853,8</b>	<b>682,7</b>	<b>359,5</b>	<b>189,8</b>	<b>171,2</b>	<b>512,0</b>	<b>152,0</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	3,1 %	4,6 %	3,3 %	3,4 %
15-35	3,0 %	3,2 %	3,4 %	3,3 %
36-60	-	3,8 %	3,6 %	3,7 %
61-90	-	3,8 %	1,2 %	2,8 %
91-180	-	4,1 %	3,3 %	3,5 %
>180	3,6 %	3,7 %	3,3 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,4 %</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	126	3004	2426	7	64	2172	2367	2	103	2648	2456
Intragrupa y off-shore***	0	0	1304	922	0	0	1285	614	0	0	1430	1179
Otros	126	17	493	1452	64	7	588	1065	103	2	552	995
<b>Total</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>4801</b>	<b>4801</b>	<b>71</b>	<b>71</b>	<b>4046</b>	<b>4046</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>4630</b>	<b>4630</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.