

Fecha de Publicación: 2 de febrero de 2013

Fecha de Información: 31 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\$1288,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.<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	208,7	175,1	95,3	70,0	24,9	83,7	55,0
15-35	305,8	378,6	218,8	79,0	61,9	128,8	98,0
36-60	90,1	39,3	0,0	0,0	39,3	90,1	0,0
61-90	8,9	25,9	5,0	0,0	20,9	8,9	0,0
91-180	69,0	22,6	0,0	0,0	22,6	69,0	0,0
>180	55,0	92,9	20,0	25,0	42,9	0,0	30,0
<b>Total</b>	<b>737,4</b>	<b>734,5</b>	<b>339,0</b>	<b>174,0</b>	<b>212,5</b>	<b>380,4</b>	<b>183,0</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	3,2 %	1,6 %	1,3 %	1,8 %
15-35	3,1 %	3,2 %	3,0 %	3,1 %
36-60	-	2,9 %	2,8 %	2,8 %
61-90	-	3,3 %	-0,8 %	2,2 %
91-180	-	3,5 %	3,0 %	3,1 %
>180	3,3 %	3,3 %	3,3 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>2,5 %</b>	<b>2,8 %</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	28 de ene. al 1 de febrero				4 al 8 de febrero				11 al 15 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	83	2874	2459	2	183	3225	2825	3	91	2691	2684
Intragrupa y off-shore***	0	0	1309	1089	0	0	1720	1372	0	0	1755	901
Otros	83	7	580	1215	183	2	497	1246	90	3	503	1364
<b>Total</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>4764</b>	<b>4764</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>5442</b>	<b>5442</b>	<b>93</b>	<b>93</b>	<b>4949</b>	<b>4949</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.