

Fecha de Publicación: 5 de febrero de 2013

Fecha de Información: 01 de febrero 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\$926,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.<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	111,9	181,4	160,2	48,0	1,2	43,9	20,0
15-35	281,4	223,7	158,0	183,7	33,7	65,7	32,0
36-60	27,6	9,8	0,0	0,0	9,8	27,6	0,0
61-90	90,9	36,4	0,8	60,0	5,6	0,9	30,0
91-180	15,9	8,1	0,0	0,0	8,1	15,9	0,0
>180	17,0	4,4	0,0	0,0	4,4	17,0	0,0
<b>Total</b>	<b>544,7</b>	<b>463,8</b>	<b>319,0</b>	<b>291,7</b>	<b>62,8</b>	<b>171,0</b>	<b>82,0</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	3,5 %	1,9 %	2,3 %	2,2 %
15-35	3,5 %	3,6 %	3,0 %	3,3 %
36-60	-	3,4 %	3,0 %	3,1 %
61-90	2,2 %	3,8 %	3,4 %	3,0 %
91-180	-	4,0 %	3,1 %	3,4 %
>180	-	3,8 %	3,1 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>2,9 %</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	82	2874	2458	15	183	3288	2986	13	91	2716	2704
Intragrupa y off-shore***	0	0	1309	1089	0	0	1880	1420	0	0	1755	901
Otros	82	7	579	1215	183	15	499	1261	90	13	504	1369
<b>Total</b>	<b>88</b>	<b>88</b>	<b>4762</b>	<b>4762</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>5667</b>	<b>5667</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>4975</b>	<b>4975</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.