

Fecha de Publicación: 9 de febrero de 2013

Fecha de Información: 07 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\$1404,6 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	91,7	102,7	75,5	26,8	26,2	63,9	1,0
15-35	498,9	463,9	323,0	68,3	38,9	328,6	102,0
36-60	136,2	54,5	0,0	0,0	54,5	136,2	0,0
61-90	45,1	14,0	0,0	0,0	4,0	35,1	10,0
91-180	74,3	12,9	0,0	33,8	12,5	40,1	0,4
>180	17,0	6,9	0,0	7,8	6,9	9,2	0,0
<b>Total</b>	<b>863,2</b>	<b>654,8</b>	<b>398,5</b>	<b>136,6</b>	<b>142,9</b>	<b>613,2</b>	<b>113,4</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	4,2 %	2,9 %	3,0 %	2,9 %
15-35	3,1 %	3,3 %	3,2 %	3,2 %
36-60	-	3,6 %	3,4 %	3,4 %
61-90	1,6 %	3,9 %	3,4 %	3,1 %
91-180	3,1 %	3,8 %	3,0 %	3,2 %
>180	-	4,0 %	2,6 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,2 %</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**

Sector	4 al 8 de febrero				11 al 15 de febrero				18 al 22 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	188	3721	3238	15	92	2959	3055	12	92	2232	2686
Intragrupa y off-shore***	0	0	1968	1675	0	1	1945	949	0	0	1861	777
Otros	188	27	535	1312	92	13	532	1432	92	12	399	1029
<b>Total</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>6225</b>	<b>6225</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>5436</b>	<b>5436</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>4492</b>	<b>4492</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.