

Fecha de Publicación: 13 de febrero de 2013

Fecha de Información: 11 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\$1259,1 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	220,8	249,1	198,4	102,0	10,6	78,7	40,1
15-35	220,4	212,1	191,0	185,6	13,1	26,8	8,0
36-60	207,6	101,6	10,0	21,0	91,6	186,6	0,0
61-90	25,3	7,1	0,0	20,0	7,1	5,3	0,0
91-180	10,6	28,5	0,8	0,0	27,7	10,6	0,0
>180	0,0	23,9	0,0	0,0	23,9	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>684,8</b>	<b>622,4</b>	<b>400,2</b>	<b>328,6</b>	<b>174,1</b>	<b>308,1</b>	<b>48,1</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	3,6 %	1,7 %	3,4 %	2,6 %
15-35	3,7 %	2,7 %	2,7 %	2,7 %
36-60	-	3,4 %	3,0 %	3,1 %
61-90	-	3,8 %	3,2 %	3,3 %
91-180	-	3,9 %	2,8 %	3,6 %
>180	-	3,3 %	-	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>2,6 %</b>	<b>3,0 %</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	11 al 15 de febrero				18 al 22 de febrero				25 de feb. al 1 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	15	99	3150	3290	12	95	2513	2779	5	105	2439	2628
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	1	2128	1018	0	0	1881	854	0	0	1578	860
<b>Otros</b>	99	14	524	1493	95	12	433	1193	104	5	562	1092
<b>Total</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>5802</b>	<b>5802</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>4826</b>	<b>4826</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>4579</b>	<b>4579</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.