

Fecha de Publicación: 18 de marzo de 2013

Fecha de Información: 14 de marzo 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\$1078,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.<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	339,8	253,2	57,0	76,0	31,1	98,7	165,1
15-35	161,6	373,6	342,4	26,0	13,3	117,6	18,0
36-60	3,4	8,1	0,0	0,0	8,1	3,4	0,0
61-90	11,6	12,4	0,0	5,0	12,4	6,6	0,0
91-180	30,6	14,1	5,0	30,0	9,1	0,6	0,0
>180	23,1	40,4	10,0	0,9	20,4	12,3	10,0
<b>Total</b>	<b>570,1</b>	<b>701,8</b>	<b>414,4</b>	<b>137,9</b>	<b>94,4</b>	<b>239,2</b>	<b>193,1</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	1,8 %	3,6 %	2,5 %	2,4 %
15-35	3,5 %	4,5 %	2,3 %	3,6 %
36-60	-	3,7 %	3,0 %	3,5 %
61-90	-	3,4 %	3,2 %	3,3 %
91-180	-	3,4 %	2,9 %	3,4 %
>180	3,1 %	3,3 %	2,9 %	3,1 %
<b>Total</b>	<b>2,1 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>2,5 %</b>	<b>3,0 %</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**

Sectores	11 al 15 de marzo				18 al 22 de marzo				25 al 29 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	128	3411	3495	16	264	3692	4341	3	36	784	914
Intragrupa y off-shore***	5	1	2289	1421	0	0	2947	949	0	0	374	62
Otros	123	30	703	1487	264	16	575	1923	36	3	130	312
<b>Total</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>6403</b>	<b>6403</b>	<b>280</b>	<b>280</b>	<b>7213</b>	<b>7213</b>	<b>39</b>	<b>39</b>	<b>1287</b>	<b>1287</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.