

Fecha de Publicación: 23 de marzo de 2013

Fecha de Información: 21 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\$2665,4 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	455,1	118,6	15,0	275,0	43,6	120,1	60,0
15-35	679,4	1098,1	916,5	226,0	109,6	381,4	72,0
36-60	66,6	116,6	65,0	0,0	51,6	66,6	0,0
61-90	49,6	25,0	0,0	1,7	25,0	47,9	0,0
91-180	23,9	47,5	45,0	0,2	2,5	23,7	0,0
>180	102,7	14,3	0,0	7,6	14,3	95,1	0,0
<b>Total</b>	<b>1377,3</b>	<b>1420,1</b>	<b>1041,5</b>	<b>510,5</b>	<b>246,6</b>	<b>734,9</b>	<b>132,0</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	3,6 %	5,0 %	2,8 %	3,2 %
15-35	1,9 %	3,5 %	2,9 %	3,2 %
36-60	-	2,7 %	3,2 %	2,9 %
61-90	-	3,1 %	3,1 %	3,1 %
91-180	-	3,4 %	2,9 %	3,2 %
>180	-	3,4 %	3,0 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>2,9 %</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	18 al 22 de marzo				25 al 29 de marzo				1 al 5 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	297	5029	4756	4	36	959	1082	4	84	3156	2676
Intragrupa y off-shore***	0	0	3245	2007	0	0	411	123	0	0	1552	740
Otros	296	19	579	2090	36	4	159	324	84	4	599	1890
<b>Total</b>	<b>316</b>	<b>316</b>	<b>8853</b>	<b>8853</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>1529</b>	<b>1529</b>	<b>88</b>	<b>88</b>	<b>5306</b>	<b>5306</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.