

**Fecha de Publicación: 8 de enero de 2013**

**Fecha de Información: 03 de enero 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\$1582,2 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	132,9	273,2	214,1	48,9	3,1	28,0	56,0
15-35	545,8	497,7	330,0	344,6	31,7	65,2	136,0
36-60	2,3	18,2	11,6	0,4	6,7	2,0	0,0
61-90	48,5	38,2	0,0	35,4	28,2	3,1	10,0
91-180	25,0	47,5	0,0	10,0	32,5	0,0	15,0
>180	68,0	129,8	75,0	40,0	26,8	0,0	28,0
<b>Total</b>	<b>822,5</b>	<b>1004,7</b>	<b>630,7</b>	<b>479,3</b>	<b>129,0</b>	<b>98,2</b>	<b>245,0</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	2,8 %	2,7 %	2,2 %	2,6 %
15-35	2,7 %	2,6 %	2,7 %	2,7 %
36-60	-	3,7 %	3,0 %	3,6 %
61-90	3,7 %	3,8 %	2,9 %	3,3 %
91-180	4,0 %	3,5 %	2,3 %	3,5 %
>180	3,5 %	3,7 %	3,3 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>2,7 %</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**

Sectores	31 de dic. al 4 de enero				7 al 11 de enero				14 al 18 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	2	29	1424	1826	9	38	2576	2825	17	86	2320	2326
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1204	702	0	1	1654	1120	0	0	1289	617
<b>Otros</b>	29	2	260	360	38	8	416	701	85	17	538	1204
<b>Total</b>	<b>31</b>	<b>31</b>	<b>2888</b>	<b>2888</b>	<b>47</b>	<b>47</b>	<b>4646</b>	<b>4646</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>4148</b>	<b>4148</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.