

**Fecha de Publicación: 10 de enero de 2013**

**Fecha de Información: 08 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\$811,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupos y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	160,2	123,0	105,8	143,9	7,3	6,3	10,0
15-35	310,6	155,1	121,0	105,0	13,6	185,1	20,5
36-60	30,5	12,0	0,0	23,0	12,0	7,5	0,0
61-90	14,5	3,9	0,0	0,0	3,9	14,5	0,0
91-180	0,6	8,6	0,0	0,0	8,6	0,6	0,0
>180	10,4	12,2	3,0	0,0	9,2	10,4	0,0
<b>Total</b>	<b>526,8</b>	<b>314,9</b>	<b>229,8</b>	<b>271,9</b>	<b>54,7</b>	<b>224,4</b>	<b>30,5</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	3,7 %	3,4 %	3,6 %	3,5 %
15-35	1,8 %	3,3 %	3,4 %	3,3 %
36-60	-	3,9 %	2,8 %	3,1 %
61-90	-	4,1 %	3,4 %	3,6 %
91-180	-	4,6 %	3,2 %	4,5 %
>180	-	4,0 %	3,4 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,4 %</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	7 al 11 de enero				14 al 18 de enero				21 al 25 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	40	2678	2993	26	90	2447	2414	9	123	1764	1922
Intragrupos y off-shore***	0	1	1832	1274	0	0	1309	642	0	0	1152	498
Otros	40	14	405	649	89	26	560	1261	123	9	392	888
<b>Total</b>	<b>55</b>	<b>55</b>	<b>4916</b>	<b>4916</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>4316</b>	<b>4316</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>3307</b>	<b>3307</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.