

Fecha de Publicación: 08 de Octubre de 2012  
 Fecha de Información: 04 de Octubre de 2012 <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\$1350,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.<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	246,4	306,3	200,0	111,4	16,3	45,0	90,0
15-35	355,6	411,4	266,0	88,0	54,4	176,6	91,0
36-60	20,3	4,4	0,0	20,0	4,4	0,3	0,0
61-90	15,0	58,4	40,7	5,0	7,6	0,0	10,0
91-180	49,5	54,4	5,0	0,0	44,4	44,5	5,0
>180	15,0	15,2	10,0	0,0	0,2	10,0	5,0
<b>Total</b>	<b>701,9</b>	<b>850,0</b>	<b>521,7</b>	<b>224,4</b>	<b>127,3</b>	<b>276,5</b>	<b>201,0</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 %	4,7 %	1,2 %	3,1 %
15-35	5,0 %	5,3 %	5,4 %	5,3 %
36-60	-	5,4 %	5,6 %	5,6 %
61-90	5,4 %	5,3 %	2,4 %	5,1 %
91-180	5,3 %	4,6 %	4,6 %	4,6 %
>180	4,4 %	4,5 %	4,3 %	4,4 %
<b>Total</b>	<b>4,0 %</b>	<b>5,0 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,5 %</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	1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre				15 al 19 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	141	41	3168	3536	62	47	2447	2954	9	73	1714	2360
Intragrupa y off-shore***	0	0	2465	1442	0	1	1861	1130	0	0	1423	447
Otros	41	141	286	941	47	61	423	647	73	9	401	730
<b>Total</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>5919</b>	<b>5919</b>	<b>109</b>	<b>109</b>	<b>4731</b>	<b>4731</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>3537</b>	<b>3537</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.