

Fecha de Publicación: 12 de Octubre de 2012  
 Fecha de Información: 10 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\$1311,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.<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	390,1	141,6	57,5	273,4	4,1	36,7	80,0
15-35	327,1	355,8	272,8	166,3	12,0	89,8	71,0
36-60	3,1	53,8	50,0	0,0	3,8	3,1	0,0
61-90	18,3	12,0	0,0	0,0	2,0	8,3	10,0
91-180	2,1	9,9	0,4	0,0	9,5	2,1	0,0
>180	70,6	152,6	20,0	5,0	67,6	0,6	65,0
<b>Total</b>	<b>811,4</b>	<b>725,7</b>	<b>400,7</b>	<b>444,7</b>	<b>99,0</b>	<b>140,7</b>	<b>226,0</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	4,3 %	2,7 %	3,6 %	3,6 %
15-35	4,8 %	5,2 %	4,8 %	4,9 %
36-60	-	5,8 %	5,0 %	5,4 %
61-90	3,9 %	5,7 %	4,9 %	4,5 %
91-180	-	4,7 %	4,0 %	4,5 %
>180	3,5 %	4,3 %	4,1 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,6 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,3 %</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	8 al 12 de Octubre				15 al 19 de Octubre				22 al 26 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	66	46	3085	3310	12	76	1866	2487	90	95	1818	2036
Intragrupa y off-shore***	0	1	2070	1561	0	0	1520	524	0	0	1220	485
Otros	46	64	429	714	76	12	406	780	95	90	373	890
<b>Total</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>5585</b>	<b>5585</b>	<b>88</b>	<b>88</b>	<b>3792</b>	<b>3792</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>3411</b>	<b>3411</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.