

Fecha de Publicación: 16 de Octubre de 2012  
 Fecha de Información: 11 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\$1510,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	347,9	332,9	106,3	176,8	71,7	16,2	155,0
15-35	417,6	390,8	287,0	255,5	32,3	90,6	71,5
36-60	0,2	6,5	0,0	0,0	6,5	0,2	0,0
61-90	16,6	20,2	0,0	0,0	5,2	1,6	15,0
91-180	77,7	12,4	7,0	77,0	5,4	0,7	0,0
>180	17,7	126,4	105,0	0,0	6,4	2,7	15,0
<b>Total</b>	<b>877,7</b>	<b>889,2</b>	<b>505,3</b>	<b>509,3</b>	<b>127,5</b>	<b>111,9</b>	<b>256,5</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,6 %	5,3 %	3,6 %	4,4 %
15-35	5,2 %	5,4 %	5,2 %	5,3 %
36-60	-	6,3 %	4,9 %	6,2 %
61-90	5,3 %	5,4 %	4,6 %	5,3 %
91-180	-	5,1 %	4,9 %	4,9 %
>180	4,3 %	4,3 %	4,2 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>4,8 %</b>	<b>5,1 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>4,9 %</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	3207	3389	12	77	2061	2665	90	94	1846	2112
Intragruppo y off-shore***	0	1	2072	1664	0	0	1562	577	0	0	1283	506
Otros	46	64	487	713	77	12	407	787	94	90	386	897
<b>Total</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>5766</b>	<b>5766</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>4030</b>	<b>4030</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>3515</b>	<b>3515</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 intragruppo.