

Fecha de Publicación: 17 de Octubre de 2012  
 Fecha de Información: 12 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\$1219,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.<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	316,8	326,5	25,0	30,0	44,5	29,8	257,0
15-35	243,2	474,2	451,0	112,0	3,2	111,2	20,0
36-60	7,2	4,9	0,0	0,0	4,9	7,2	0,0
61-90	0,1	12,4	0,0	0,0	12,4	0,1	0,0
91-180	73,0	22,3	7,0	15,0	15,3	58,0	0,0
>180	15,1	0,3	0,0	15,0	0,3	0,1	0,0
<b>Total</b>	<b>655,3</b>	<b>840,7</b>	<b>483,0</b>	<b>172,0</b>	<b>80,7</b>	<b>206,3</b>	<b>277,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,6 %	7,1 %	4,3 %	4,3 %
15-35	11,8 %	5,0 %	3,5 %	4,7 %
36-60	-	5,9 %	5,2 %	5,5 %
61-90	-	5,6 %	4,1 %	5,6 %
91-180	-	5,2 %	5,1 %	5,1 %
>180	-	4,7 %	4,6 %	4,6 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</b>	<b>5,3 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>4,6 %</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	39	3207	3373	12	72	2333	2938	91	96	1893	2174
Intragruppo y off-shore***	0	1	2072	1664	0	0	1587	607	0	0	1283	506
Otros	39	64	471	713	72	12	444	818	96	91	403	898
<b>Total</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>5750</b>	<b>5750</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>4364</b>	<b>4364</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>3578</b>	<b>3578</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.