

Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2012  
 Fecha de Información: 22 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\$1787,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.<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	302,1	411,3	214,6	96,0	60,7	70,1	136,0
15-35	645,2	561,4	280,7	250,1	28,7	143,1	252,0
36-60	2,1	7,1	0,0	0,0	7,1	2,1	0,0
61-90	0,4	0,6	0,0	0,0	0,6	0,4	0,0
91-180	113,9	75,6	30,0	0,0	20,6	88,9	25,0
>180	65,9	15,2	15,0	20,0	0,2	45,9	0,0
<b>Total</b>	<b>1129,6</b>	<b>1071,2</b>	<b>540,3</b>	<b>366,1</b>	<b>117,9</b>	<b>350,5</b>	<b>413,0</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	0,8 %	6,4 %	5,2 %	4,7 %
15-35	4,4 %	5,6 %	5,5 %	5,2 %
36-60	-	6,1 %	5,5 %	5,9 %
61-90	-	5,8 %	4,1 %	5,1 %
91-180	5,0 %	5,5 %	4,9 %	5,0 %
>180	-	4,4 %	4,5 %	4,4 %
<b>Total</b>	<b>3,2 %</b>	<b>5,9 %</b>	<b>5,3 %</b>	<b>5,0 %</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

Sector	22 al 26 de octubre				29 de oct. al 2 de noviembre				5 al 9 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	92	94	2536	2829	10	101	2721	3196	88	98	1920	2133
Intragruppo y off-shore***	0	0	1627	780	0	0	1708	843	0	0	1235	634
Otros	94	92	443	997	101	10	668	1059	98	88	354	743
<b>Total</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>4606</b>	<b>4606</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>5097</b>	<b>5097</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>3510</b>	<b>3510</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.