

Fecha de Publicación: 25 de octubre de 2012  
 Fecha de Información: 23 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\$1451,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
 Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	299,9	204,5	110,6	204,5	29,9	31,4	64,0
15-35	359,8	415,8	332,8	192,0	5,5	90,3	77,5
36-60	27,2	57,5	26,2	15,0	31,3	12,2	0,0
61-90	5,3	3,9	0,0	0,0	3,9	5,3	0,0
91-180	86,9	89,2	75,0	0,0	14,2	86,9	0,0
>180	21,0	22,2	20,0	0,0	2,2	21,0	0,0
<b>Total</b>	<b>800,1</b>	<b>793,1</b>	<b>564,6</b>	<b>411,5</b>	<b>87,0</b>	<b>247,1</b>	<b>141,5</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,6 %	5,3 %	2,5 %	3,5 %
15-35	5,5 %	5,3 %	4,5 %	5,0 %
36-60	-	5,4 %	5,2 %	5,4 %
61-90	-	4,2 %	4,7 %	4,5 %
91-180	-	4,4 %	4,7 %	4,5 %
>180	-	4,7 %	3,8 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>4,6 %</b>	<b>5,2 %</b>	<b>3,9 %</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	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	93	2744	2911	11	101	2803	3296	89	103	1935	2161
Intragrupo y off-shore***	0	0	1640	917	0	0	1805	905	0	0	1240	639
Otros	93	92	447	1003	100	11	672	1078	103	89	378	752
<b>Total</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>4831</b>	<b>4831</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>5279</b>	<b>5279</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>3553</b>	<b>3553</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.