

Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2012  
 Fecha de Información: 25 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\$1438,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.<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	197,2	232,1	113,4	83,1	31,8	27,2	87,0
15-35	548,6	547,0	354,5	203,8	69,6	221,8	123,0
36-60	8,1	1,8	0,0	0,0	1,8	8,1	0,0
61-90	28,6	40,8	20,0	0,0	0,8	8,6	20,0
91-180	15,1	24,1	20,0	0,0	4,1	15,1	0,0
>180	7,3	18,1	18,0	5,0	0,1	2,3	0,0
<b>Total</b>	<b>805,0</b>	<b>864,0</b>	<b>525,8</b>	<b>291,8</b>	<b>108,2</b>	<b>283,2</b>	<b>230,0</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	3,9 %	5,5 %	2,6 %	4,1 %
15-35	2,9 %	4,5 %	4,8 %	4,4 %
36-60	-	5,1 %	4,7 %	4,8 %
61-90	5,0 %	5,1 %	4,3 %	4,9 %
91-180	-	4,7 %	4,5 %	4,6 %
>180	-	4,3 %	3,8 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>4,4 %</b>	<b>4,4 %</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	92	3030	3007	12	101	3026	3611	89	100	2017	2240
Intragruppo y off-shore***	0	0	1656	1122	0	0	2007	940	0	0	1276	684
Otros	92	92	446	1003	100	12	701	1182	100	89	393	761
<b>Total</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>5131</b>	<b>5131</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>5734</b>	<b>5734</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>3685</b>	<b>3685</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.