

Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2012  
 Fecha de Información: 26 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\$1152,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
 Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	320,5	154,1	73,3	203,0	15,9	52,5	65,0
15-35	270,4	330,4	272,0	131,0	4,4	85,4	54,0
36-60	9,6	39,3	10,0	0,0	29,3	9,6	0,0
61-90	8,0	55,3	45,0	0,0	10,3	8,0	0,0
91-180	25,2	21,3	0,0	0,0	21,3	25,2	0,0
>180	22,3	15,1	0,0	0,0	15,1	22,3	0,0
<b>Total</b>	<b>656,1</b>	<b>615,6</b>	<b>400,3</b>	<b>334,0</b>	<b>96,3</b>	<b>203,1</b>	<b>119,0</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	2,5 %	5,0 %	4,4 %	4,2 %
15-35	4,5 %	5,1 %	4,5 %	4,8 %
36-60	-	5,0 %	4,2 %	4,9 %
61-90	-	4,9 %	4,1 %	4,8 %
91-180	-	4,6 %	4,0 %	4,3 %
>180	-	4,1 %	3,7 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>5,0 %</b>	<b>4,4 %</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

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	104	3030	3006	12	80	3313	3723	89	100	2050	2305
Intragrupa y off-shore***	0	0	1656	1122	0	0	2052	1143	0	0	1304	684
Otros	104	92	445	1003	80	12	732	1231	100	89	400	764
<b>Total</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>5130</b>	<b>5130</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>6097</b>	<b>6097</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>3753</b>	<b>3753</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.