

Fecha de Publicación: 07 de noviembre de 2012  
 Fecha de Información: 02 de noviembre 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\$786,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.<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	205,6	272,9	107,8	53,4	59,1	46,1	106,0
15-35	157,8	126,7	55,0	111,8	66,7	41,0	5,0
36-60	2,7	14,8	0,0	0,0	14,8	2,7	0,0
61-90	5,1	25,0	20,0	0,0	5,0	5,1	0,0
91-180	16,9	49,7	40,0	0,0	9,7	16,9	0,0
>180	8,2	12,5	10,0	0,0	2,5	8,2	0,0
<b>Total</b>	<b>396,2</b>	<b>501,5</b>	<b>232,8</b>	<b>165,2</b>	<b>157,7</b>	<b>120,1</b>	<b>111,0</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	4,6 %	4,3 %	2,2 %	3,8 %
15-35	4,3 %	4,8 %	3,9 %	4,3 %
36-60	-	5,1 %	3,8 %	4,9 %
61-90	-	2,5 %	3,5 %	2,6 %
91-180	-	4,2 %	3,7 %	4,1 %
>180	-	3,8 %	3,4 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>4,6 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>4,0 %</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	29 de oct. al 2 de noviembre				5 al 9 de noviembre				12 al 16 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	84	3940	4014	103	105	2780	3095	45	59	2105	2739
Intragrupa y off-shore***	0	0	2189	1558	0	0	1629	889	0	1	1677	965
Otros	83	18	722	1279	104	103	472	897	59	44	445	523
<b>Total</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>6851</b>	<b>6851</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>4881</b>	<b>4881</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>4227</b>	<b>4227</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.