

Fecha de Publicación: 20 de noviembre de 2012  
 Fecha de Información: 16 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\$943,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.<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	181,6	254,0	170,0	50,5	24,0	71,1	60,0
15-35	247,1	270,3	168,7	130,2	5,6	20,9	96,0
36-60	1,4	7,0	3,0	0,0	4,0	1,4	0,0
61-90	20,7	58,2	0,0	0,0	58,2	20,7	0,0
91-180	3,8	33,6	0,0	0,1	33,6	3,8	0,0
>180	11,2	10,4	0,0	10,0	10,4	1,2	0,0
<b>Total</b>	<b>465,8</b>	<b>633,5</b>	<b>341,7</b>	<b>190,8</b>	<b>135,8</b>	<b>119,1</b>	<b>156,0</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	3,4 %	5,3 %	5,5 %	5,0 %
15-35	5,3 %	4,3 %	4,9 %	4,8 %
36-60	-	5,5 %	4,2 %	5,3 %
61-90	-	4,8 %	4,6 %	4,7 %
91-180	-	4,2 %	3,9 %	4,1 %
>180	-	4,0 %	3,8 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>4,6 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,1 %</b>	<b>4,8 %</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	12 al 16 de noviembre				19 al 23 de noviembre				26 al 30 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	51	163	2963	3383	32	101	2905	3854	40	86	2694	3041
Intragrupa y off-shore***	0	1	2035	1531	0	0	2412	1255	0	0	1753	1002
Otros	163	50	505	588	101	32	582	791	86	40	535	939
<b>Total</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>5502</b>	<b>5502</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>5899</b>	<b>5899</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>4982</b>	<b>4982</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.